

1. Zadatak - Analiza portfelja

Odaberite 3 dionice te preuzmite povijesne podatke dnevnog kretanja njihovih cijena u zadnjih 5 godina (izvor za povijesne podatke npr. ZSE za hrvatske dionice, Yahoo Finance za strane...).

Izračunajte očekivani povrat i rizičnost (=standardna devijacija povrata) na dnevnoj i mjesečnoj razini.

Nakon toga formirajte nekoliko (3, 4) portfelja od svojih dionica tako da varirate udjele investirane u pojedinu dionicu. Nađite očekivane povrate i rizičnosti za svoje portfelje, te ih prikažite na grafu zajedno s dionicama (standardna devijacija na x os, očekivani povrat na y os). Dodatno, pokušajte pronaći portfelj minimalne varijance za te 3 dionice.

Alternativno umjesto dionica možete odabrati i cijene neka 3 investicijska fonda.