

# OBSAH

1	<u>Úvod</u>	5
2	<u>Cíle disertační práce</u>	5
3	<u>Teorie portfolia</u>	6
3.1	<u>Markowitzův model</u>	6
3.2	<u>CAPM</u>	7
3.3	<u>Faktorové modely</u>	7
4	<u>Metody zpracování disertační práce</u>	9
5	<u>Řešení disertační práce</u>	9
5.1	<u>Burza cenných papírů Praha</u>	9
5.2	<u>Analýza vztahu indexu PX50 a vybraných makroekonomických veličin</u>	10
5.3	<u>Možnosti využití jednofaktorových modelů pro odhad koeficientů <math>\alpha</math> a <math>\beta</math></u>	13
5.4	<u>Odhad koeficientů alfa a beta</u>	13
5.5	<u>Program pro výpočet optimálního portfolia</u>	14
5.6	<u>Výběr akcií pro zařazení do portfolií</u>	14
5.7	<u>Navržené složení portfolií</u>	15
5.8	<u>Zhodnocení úspěšnosti navržených portfolií</u>	17
5.9	<u>Podmínky nutné pro úspěšné sestavení portfolia</u>	18
5.10	<u>Metodika sestavování optimálního portfolia</u>	18
6	<u>Závěry plynoucí z disertační práce</u>	20
6.1	<u>Závěry disertační práce:</u>	20
6.2	<u>Přínosy pro vědu a praxi</u>	20
7	<u>Literatura použitá v disertační práci</u>	22
8	<u>ŽIVOTOPIS</u>	25

## 2 CÍLE DISERTAČNÍ PRÁCE