

14 Utregning av effisient sett og porteføljefront.

Vi ser på et marked med tre investeringsalternativer (ingen risikofrie), karakterisert ved:

$$\mu = \begin{pmatrix} 0.06 \\ 0.08 \\ 0.11 \end{pmatrix}$$

og

$$V = \begin{pmatrix} 0.0025 & -0.002 & 0.003 \\ -0.002 & 0.01 & 0.01 \\ 0.003 & 0.01 & 0.04 \end{pmatrix}$$

Regn ut x^{MIN} og z^* .

Illustrér porteføljefronten grafisk både i (r, σ^2) -planet og i (r, σ) -planet.