

Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer



Filesize: 2.58 MB

Reviews

A must buy book if you need to adding benefit. It is actually rally fascinating throgh studying time. Your way of life span will likely be transform as soon as you complete looking over this publication.
(Ms. Bernice Rolfson)

SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER

DOWNLOAD



To save **Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer** PDF, make sure you access the button beneath and download the file or gain access to additional information that are related to **SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER** ebook.

GRIN Verlag Nov 2013, 2013. Taschenbuch. Book Condition: Neu. 211x149x5 mm. This item is printed on demand - Print on Demand Neuware - Studienarbeit aus dem Jahr 2004 im Fachbereich Mathematik - Angewandte Mathematik, Note: 2,7, Technische Universität München, 14 Quellen im Literaturverzeichnis, Sprache: Deutsch, Abstract: Seit der bahnbrechenden Arbeit von Markowitz, ist die Portfolio Theorie aus dem Asset Management nicht mehr wegzudenken. Wichtige Bestandteile seiner Theorie sind die erwartete Aktienrendite und das Risiko, das durch die Kovarianzmatrix ausgedrückt wird. Das Schätzen der Kovarianzmatrix kann zu größeren Problemen führen. Wenige Ausreißer reichen aus, um die Schätzer zu verzerren und somit unbrauchbar zu machen. Kapitel 1 zeigt welche Auswirkungen einzelne Ausreißer haben und wie diese durch die 'bloße' Anwendung von robusten anstatt klassischen Schätzverfahren vermieden werden können. Doch auch diese haben Nachteile; darum wurden andere Verfahren entwickelt, wie z.B. die sog. 'paarweisen' Schätzmethoden, bei der anstatt der gesamten Matrix die einzelnen Einträge der Matrix geschätzt werden. Eine weitere Schätzmethode ist das Shrinkage-Verfahren, das in Kapitel 2, ausgehend von einem quadratischen Optimierungsproblem, gezeigt wird. Des Weiteren wird eine praktische Anleitung der Alpharegel vorgestellt, bei der ein aktiver Portfoliomanager, der von einer Benchmark abweichen will, sog. Alphaprognozen erhält, die den Input seiner Arbeit darstellen. Kapitel 3 beschäftigt sich mit empirischen Korrelationsmatrizen und der Annahme, dass diese zufällig verteilt sind. Die Ergebnisse führten dazu, dass die Portfoliotheorie von Markowitz zunächst in Frage gestellt wurde, durch die Erkenntnisse in Kapitel 4 aber wieder verworfen werden konnte. 28 pp. Deutsch.



[Read Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer Online](#)



[Download PDF Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer](#)



[Download ePub Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten](#)

[Schätzer](#)

Other Kindle Books



[PDF] Psychologisches Testverfahren

Follow the web link listed below to get "Psychologisches Testverfahren" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] Programming in D

Follow the web link listed below to get "Programming in D" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs

Follow the web link listed below to get "Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] Have You Locked the Castle Gate?

Follow the web link listed below to get "Have You Locked the Castle Gate?" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] The Java Tutorial (3rd Edition)

Follow the web link listed below to get "The Java Tutorial (3rd Edition)" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] Studyguide for Constructive Guidance and Discipline: Preschool and Primary Education by Marjorie V. Fields ISBN: 9780136035930

Follow the web link listed below to get "Studyguide for Constructive Guidance and Discipline: Preschool and Primary Education by Marjorie V. Fields ISBN: 9780136035930" PDF file.

[Save Book »](#)



[PDF] ESV Study Bible, Large Print (Hardback)

Access the web link listed below to get "ESV Study Bible, Large Print (Hardback)" file.

[Download ePub »](#)



[PDF] First Fairy Tales

Access the web link listed below to get "First Fairy Tales" file.

[Download ePub »](#)



[PDF] TJ new concept of the Preschool Quality Education Engineering: new happy learning young children (3-5 years old) daily learning book Intermediate (2)(Chinese Edition)

Access the web link listed below to get "TJ new concept of the Preschool Quality Education Engineering: new happy learning young children (3-5 years old) daily learning book Intermediate (2)(Chinese Edition)" file.

[Download ePub »](#)



[PDF] In Nature s Realm, Op.91 / B.168: Study Score (Paperback)

Access the web link listed below to get "In Nature s Realm, Op.91 / B.168: Study Score (Paperback)" file.

[Download ePub »](#)



[PDF] TJ new concept of the Preschool Quality Education Engineering the daily learning book of: new happy learning young children (3-5 years) Intermediate (3)(Chinese Edition)

Access the web link listed below to get "TJ new concept of the Preschool Quality Education Engineering the daily learning book of: new happy learning young children (3-5 years) Intermediate (3)(Chinese Edition)" file.

[Download ePub »](#)



[PDF] Slavonic Rhapsodies, Op.45 / B.86: Study Score (Paperback)

Access the web link listed below to get "Slavonic Rhapsodies, Op.45 / B.86: Study Score (Paperback)" file.

[Download ePub »](#)