

Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer



Filesize: 8.74 MB

Reviews

A brand new eBook with a brand new standpoint. It can be rally fascinating throgh reading through time. I am happy to let you know that this is the greatest ebook i have go through within my very own daily life and can be he best book for at any time.

(Leanne Cremin)

SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER

DOWNLOAD



To read **Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer** eBook, remember to access the button under and save the ebook or get access to additional information that are related to SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER book.

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](#)

Relevant Kindle Books



[PDF] Psychologisches Testverfahren

Follow the link under to read "Psychologisches Testverfahren" PDF file.

[Download eBook »](#)



[PDF] Programming in D

Follow the link under to read "Programming in D" PDF file.

[Download eBook »](#)



[PDF] Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs

Follow the link under to read "Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs" PDF file.

[Download eBook »](#)



[PDF] Have You Locked the Castle Gate?

Follow the link under to read "Have You Locked the Castle Gate?" PDF file.

[Download eBook »](#)



[PDF] The Java Tutorial (3rd Edition)

Follow the link under to read "The Java Tutorial (3rd Edition)" PDF file.

[Download eBook »](#)



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

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

[Download eBook »](#)