

Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer



Filesize: 3.71 MB

Reviews

*Complete guide for ebook fans. Better then never, though i am quite late in start reading this one.
Your life span will likely be convert when you full reading this ebook.*

(Dr. Teagan Beahan Sr.)

SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER

DOWNLOAD



To download **Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer** eBook, please access the button below and download the document 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](#)



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

Related PDFs



[PDF] Psychologisches Testverfahren

Access the web link beneath to download and read "Psychologisches Testverfahren" PDF file.

[Download ePub »](#)



[PDF] Programming in D

Access the web link beneath to download and read "Programming in D" PDF file.

[Download ePub »](#)



[PDF] Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs

Access the web link beneath to download and read "Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs" PDF file.

[Download ePub »](#)



[PDF] Have You Locked the Castle Gate?

Access the web link beneath to download and read "Have You Locked the Castle Gate?" PDF file.

[Download ePub »](#)



[PDF] The Java Tutorial (3rd Edition)

Access the web link beneath to download and read "The Java Tutorial (3rd Edition)" PDF file.

[Download ePub »](#)



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

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

[Download ePub »](#)

**[PDF] Strengerer Datenschutz (Paperback)**

Click the web link under to download "Strengerer Datenschutz (Paperback)" PDF document.

[Save ePub »](#)

**[PDF] Sport is Fun (Red B) NF**

Click the web link under to download "Sport is Fun (Red B) NF" PDF document.

[Save ePub »](#)

**[PDF] Never Invite an Alligator to Lunch! (Paperback)**

Click the web link under to download "Never Invite an Alligator to Lunch! (Paperback)" PDF document.

[Save ePub »](#)

**[PDF] Children s Handwriting Book of Alphabets and Numbers: Over 4,000 Tracing Units for the Beginning Writer (Paperback)**

Click the web link under to download "Children s Handwriting Book of Alphabets and Numbers: Over 4,000 Tracing Units for the Beginning Writer (Paperback)" PDF document.

[Save ePub »](#)

**[PDF] Odes Funebres, S.112: Study Score (Paperback)**

Click the web link under to download "Odes Funebres, S.112: Study Score (Paperback)" PDF document.

[Save ePub »](#)

**[PDF] Slavonic Rhapsody in A-Flat Major, B.86.3: Study Score (Paperback)**

Click the web link under to download "Slavonic Rhapsody in A-Flat Major, B.86.3: Study Score (Paperback)" PDF document.

[Save ePub »](#)