

Simulationsmethoden Zur Berechnung Des Value at Risk. Historische Simulation Und Monte-Carlo-Simulation



Filesize: 8.62 MB

Reviews

These types of book is the greatest ebook readily available. I was able to comprehend every little thing using this published e pdf. I realized this pdf from my dad and i encouraged this publication to discover.
(Dr. Porter Mitchell)

SIMULATIONSMETHODEN ZUR BERECHNUNG DES VALUE AT RISK. HISTORISCHE SIMULATION UND MONTE-CARLO-SIMULATION

[DOWNLOAD PDF](#)

Grin Verlag GmbH. Paperback. Condition: New. 32 pages. Dimensions: 8.1in. x 5.8in. x 0.2in. Studienarbeit aus dem Jahr 2002 im Fachbereich Statistik, Note: 1,0, Universität zu Köln (Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät), Sprache: Deutsch, Abstract: Der Wert eines Portfolios von Finanzanlagen wird durch verschiedene Risikofaktoren beeinflusst. Diese Risikofaktoren sind diverse Marktpreise wie Aktienkurse, Zinssätze, Wechselkurse etc. An den Wertänderungen des Portfolios, d. h. Gewinnen oder Verlusten, kann die Abhängigkeit von den Risiken gemessen werden. Ein verbreitetes Maß zur Messung der Marktrisiken ist der Value at Risk (VaR). Kurz gefasst mit VaR den größtmöglichen Verlust aus einem Portfolio über eine Zeitperiode mit einer gegebenen Wahrscheinlichkeit. VaR ist ein monetäres Maß, das die verschiedenen Marktrisiken in eine Kennzahl komprimiert. Deswegen eignet sich der VaR dafür, den Informationsbedarf der Unternehmensleitung, der Aktionäre und Investoren zu decken. Der VaR wird aus einem Quantil einer Verteilung von Portfolio-Wertänderungen berechnet. Wenn die genaue Verteilung nicht bekannt ist, wird sie durch eine Häufigkeitsverteilung der simulierten Wertänderungen approximiert. Damit befassen sich Simulationsmodelle: historische Simulation, bei der die Wertänderungen aus den historischen Daten abgelesen werden, und Monte-Carlo-Simulation, die das Verhalten der Risikofaktoren durch die Erzeugung der zufälligen Preispfade an Hand eines stochastischen Modells simuliert. Nach einer kurzen Definition und Beschreibung der Modelle zur Bestimmung des VaR werden in dieser Arbeit die Simulationsmodelle genauer untersucht. Es werden zwei Varianten der historischen Simulation, der Portfolio- und der Faktoransatz dargestellt und an einem Beispiel verdeutlicht. Weiter wird die Monte-Carlo-Simulation allgemein und an einem theoretischen und empirischen Beispiel der geometrischen Brownschen Bewegung betrachtet. Dabei werden auch Methoden der Generierung der Zufallszahlen dargestellt. Außerdem wird in der Arbeit auf die Vor- und Nachteile der beiden Modelle eingegangen. This item ships from multiple locations. Your book may arrive from Roseburg,OR, La Vergne,TN. Paperback.

[Read Simulationmethoden Zur Berechnung Des Value at Risk. Historische Simulation Und Monte-Carlo-Simulation Online](#)[Download PDF Simulationmethoden Zur Berechnung Des Value at Risk. Historische Simulation Und Monte-Carlo-Simulation](#)

Related Books



DK Readers Animal Hospital Level 2 Beginning to Read Alone

DK CHILDREN. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 32 pages. Dimensions: 8.9in. x 5.8in. x 0.1in.This Level 2 book is appropriate for children who are beginning to read alone. When Jack and Luke take an injured...

[Download eBook](#)

»



The Day I Forgot to Pray

Tate Publishing. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 28 pages. Dimensions: 8.7in. x 5.8in. x 0.3in.Alexis is an ordinary five-year-old who likes to run and play in the sandbox. On her first day of Kindergarten, she...

[Download eBook](#)

»



DK Readers Disasters at Sea Level 3 Reading Alone

DK CHILDREN. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 32 pages. Dimensions: 8.8in. x 5.7in. x 0.2in.From fog, ice, and rocks to cannon fire and torpedo attacks--read the story of five doomed sea voyages and the fate...

[Download eBook](#)

»



DK Readers Invaders From Outer Space Level 3 Reading Alone

DK CHILDREN. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 48 pages. Dimensions: 8.9in. x 5.9in. x 0.1in.Are aliens from other planets visiting Earth Read these amazing stories of alien encounters -- and make up your own mind!...

[Download eBook](#)

»



DK Readers Flying Ace, The Story of Amelia Earhart Level 4 Proficient Readers

DK CHILDREN. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 48 pages. Dimensions: 8.8in. x 5.8in. x 0.2in.Amelia Earhart was a famous woman pilot. She is about to set off on the most dangerous flight ever attempted. Find...

[Download eBook](#)

»

**Absolutely Lucy #4 Lucy on the Ball A Stepping Stone BookTM**

Random House Books for Young Readers. Paperback. Book Condition: New. David Merrell (illustrator). Paperback. 112 pages. Dimensions: 7.4in. x 5.1in. x 0.4in. Ilene Coopers fourth story of a boy and his beagle takes Bobby and Lucy

[Read eBook](#)

»

**DK Reader Level 4 Extreme Machines DK READERS**

DK CHILDREN. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 48 pages. Dimensions: 9.0in. x 5.9in. x 0.2in. They were built to conquer land, sea, and air. Read about the biggest, fastest, most incredible machines in the world. These

[Read eBook](#)

»

**The Ghosts of Pickpocket Plantation Pretty Darn Scary Mysteries**

Gallopade International. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 109 pages. Dimensions: 7.4in. x 5.2in. x 0.3in. When you purchase the Library Bound mystery you will receive FREE online eBook access! Carole Marsh Mystery Online eBooks are an

[Read eBook](#)

»

**Viking Ships At Sunrise Magic Tree House, No. 15**

Random House Books for Young Readers. Paperback. Book Condition: New. Sal Murdocca (illustrator). Paperback. 96 pages. Dimensions: 7.4in. x 4.9in. x 0.2in. Jack and Annie are ready for their next fantasy adventure in the bestselling middle-grade

[Read eBook](#)

»

**When Santa Claus Prayed**

Xulon Press. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 28 pages. Dimensions: 9.0in. x 8.1in. x 0.3in. Dad, youre wrong about Santa Claus! I cant sit on baby Jesus lap or even see him! I cant send letters

[Read eBook](#)

»