

## Sample Kovarianz-/Korrelationsmatrizen und ihre robusten Schätzer



Filesize: 8.51 MB

### **Reviews**

*It is an awesome ebook which i actually have at any time read through. It usually fails to charge excessive. It is extremely difficult to leave it before concluding, once you begin to read the book.*

*(Dario Murazik IV)*

## SAMPLE KOVARIANZ-/KORRELATIONSMATRIZEN UND IHRE ROBUSTEN SCHÄTZER

[DOWNLOAD](#)


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. Alphaprognosen 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](#)

## Related PDFs



### Psychologisches Testverfahren

Reference Series Books LLC Nov 2011, 2011. Taschenbuch. Book Condition: Neu. 249x191x7 mm. This item is printed on demand - Print on Demand Neuware - Quelle: Wikipedia. Seiten: 100. Kapitel: Myers-Briggs-Typindikator, Keirsey Temperament Sorter, DISG,...

[Download](#) [ePub](#)

»



### Programming in D

Ali Cehreli Dez 2015, 2015. Buch. Book Condition: Neu. 264x182x53 mm. This item is printed on demand - Print on Demand Neuware - The main aim of this book is to teach D to readers...

[Download](#) [ePub](#)

»



### Adobe Indesign CS/Cs2 Breakthroughs

Peachpit Press, 2005. Softcover. Book Condition: Neu. Gebraucht - Sehr gut Unbenutzt. Schnelle Lieferung, Kartonverpackung. Abzugsfähige Rechnung. Bei Mehrfachbestellung werden die Versandkosten anteilig erstattet. - Adobe InDesign is taking the publishing world by storm and...

[Download](#) [ePub](#)

»



### Have You Locked the Castle Gate?

Addison-Wesley Professional. Softcover. Book Condition: Neu. Gebraucht - Sehr gut Unbenutzt. Schnelle Lieferung, Kartonverpackung. Abzugsfähige Rechnung. Bei Mehrfachbestellung werden die Versandkosten anteilig erstattet. - Is your computer safe Could an intruder sneak in and steal...

[Download](#) [ePub](#)

»



### The Java Tutorial (3rd Edition)

Pearson Education, 2001. Softcover. Book Condition: Neu. Gebraucht - Sehr gut Unbenutzt. Schnelle Lieferung, Kartonverpackung. Abzugsfähige Rechnung. Bei Mehrfachbestellung werden die Versandkosten anteilig erstattet. - Praise for "The Java' Tutorial, Second Edition" includes: "This book...

[Download](#) [ePub](#)

»



**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)**

paperback. Book Condition: New. Ship out in 2 business day, And Fast shipping, Free Tracking number will be provided after the shipment. Paperback. Pub Date :2005-09-01 Publisher: Chinese children before making Reading: All books are the

[Save](#) [eBook](#)

»



**Tinga Tinga Tales: Why Lion Roars - Read it Yourself with Ladybird**

Paperback. Book Condition: New. Not Signed; This is a Tinga Tinga tale inspired by traditional stories from Africa. Lion is king of Tinga Tinga but he can't roar! Can his friend Flea help Lion to

[Save](#) [eBook](#)

»



**In Nature s Realm, Op.91 / B.168: Study Score**

Petrucchi Library Press, United States, 2015. Paperback. Book Condition: New. 244 x 170 mm. Language: English . Brand New Book \*\*\*\*\* Print on Demand \*\*\*\*\*.Composed in 1891, V P irod (In Nature s Realm) is

[Save](#) [eBook](#)

»



**Serenade for Winds, Op. 44 / B. 77: Study Score**

Petrucchi Library Press, United States, 2013. Paperback. Book Condition: New. 240 x 166 mm. Language: English . Brand New Book \*\*\*\*\* Print on Demand \*\*\*\*\*.Dvorak composed this deservedly popular work 1878 shortly after the premiere

[Save](#) [eBook](#)

»



**Lans Plant Readers Clubhouse Level 1**

Barron's Educational Series. Paperback. Book Condition: New. Paperback. 24 pages. Dimensions: 8.9in. x 5.7in. x 0.3in.This is volume six, Reading Level 1, in a comprehensive program (Levels 1 and 2)for beginning readers. Two nine-book sets

[Save](#) [eBook](#)

»