

TriRisk-watch: Visualisierung Des Value-at-risk Eines Aktienportfolios - Jannis Markopoulos

[DOWNLOAD HERE](#)

In dieser Arbeit werden die Risiken eines Portfolios, bestehend aus Schweizer SMI-Aktien, mittels des Value-at-Risk-Konzeptes untersucht. Dabei wird ein Ansatz der parametrischen Familie angewandt, der unter dem Kovarianzverfahren bekannt ist. Es werden zunächst einzelne Aktien untersucht, welche linear abgebildet werden können. Für diese Positionen werden die einzelnen Value-at-Risk-Werte berechnet. Den Zusammenhang zwischen den Aktienpositionen im Portfolio bilden die paarweise Korrelationen ab. Durch eine Verbindung des Kosinussatzes mit der Portfoliogleichung können Risiken zweidimensional abgebildet werden. Diese Triangulierung (Dreiecksbildung) der Risiken von Portfoliobestandteilen ergibt ein geometrisches Vieleck, welches sukzessiv aufgebaut wird und dem Risikomanager als nützliches visuelles Analyseinstrument dient. Das Endergebnis der Triangulierung ist eine sogenannte TriRisk-Watch (Risikouhr), auf der die Value-at-Risk-Schätzungen der Einzelaktien, der Teilportfolios und des gesamten Aktienaggregates grafisch sichtbar werden.

Diplomarbeit aus dem Jahr 2006 im Fachbereich Wirtschaft - Volkswirtschaftslehre, Note: 5,

Universität de Fribourg - Universität Freiburg. Author: Markopoulos, Jannis Publisher: GRIN

Verlag Illustration: N Language: GER Title: TriRisk-Watch: Visualisierung des Value-at-Risk eines

Aktienportfolios Pages: 00062 (Encrypted PDF) On Sale: 2009-01-01 SKU-13/ISBN: 9783640376476

Category: Business & Economics : Economics - Macroeconomics

[DOWNLOAD HERE](#)

Similar manuals:

[Rothenburg Upon The River Tauber Middle Frankonia Bavaria Germany Business Sign Restaurant Altes Bruhaus](#)

[Rich Businessmen](#)

[Rich Businessmen](#)

[Rich Businessmen](#)

[Symbolic For Business Men](#)

[Symbolic For Business Men](#)

[Businesspeople And Money](#)

[Businessman And Money](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Symbolic For Right Way In Business](#)

[Businessman And Money](#)

[Businessman And Money](#)

[Businessman And Money](#)

[Symbolic For Businessmen And Money](#)

[Businessmen And Money](#)

[Businessmen And Money](#)

[Ukraine Kiev Place Of Independence Northern Part With Historical Buildings In Sowjet Realism Architecture With Glasdome Of Shopping Center Globus I Businesspeople Tourists Visitors Blue Sky 2004](#)

[Crosswalk With Yellow Car-stop Button And A Businessman Crossing. Paarl - South-Africa](#)

[Businessmann Standing In A Papership Made Of Banknote](#)

[Businessmann Standing In A Papership Made Of Banknote](#)

[Businessmann Standing In A Papership Made Of Banknote](#)

[Businesspeople Looking Through A Loupe On A Papership Made Of Euro Banknote](#)

[Businesspeople Looking Through A Loupe On A Papership Made Of Euro Banknote](#)

[Business People Looking Through A Loupe](#)

[Business People Looking Through A Loupe](#)

[Symbolic Business People Under Loupe](#)

[Accumulation Of Inflatable Multicolored Swimming Tires In Business For Beach Accessories.](#)

[Morning Mood In The Brussels City Center To The St. Michels St. Michiels Cathedral. Illuminated Business In A Wilhelminian Style Building Before Cathedral In The Blue Morning Light.](#)

[Business Manager With No Money In His Pocket Is Totally Washed Out](#)

[Business Manager With No Money In His Pocket Is Totally Washed Out](#)

[Business Manager With No Money In His Pocket Is Totally Washed Out](#)

[Business Manager With No Money In His Pocket Is Totally Washed Out](#)

[Business Manager Inserts Mobile Phone In His Pocket](#)

[Business Man In Suit Stands Still](#)

[Business Man In Suit Is Dancing Dynamic After The Conclusion Of A Contract](#)

[Business Man Is Grating Hands](#)

[Business Man Is Appeasing](#)

[Business Man Shows His Big Hand](#)

[Cool Business Man Holds His Drink](#)

[Depression - Sad Business Man Is Thinking About His Life And Suicide Holding Whiskey Glas And Gun In His Hands](#)

[Businessman Smiling](#)

[Bored Businessman](#)

[Businessman Dreaming](#)

[Businessman Reading A Financial Newspaper](#)

[Businessman Reading A Financial Newspaper](#)

[Businessman Reading A Financial Newspaper](#)