

(Get free) Statistik, konometrie, Optimierung. Methoden und ihre praktische Anwendung in Finanzanalyse und Portfoliomanagement

# Statistik, konometrie, Optimierung. Methoden und ihre praktische Anwendung in Finanzanalyse und Portfoliomanagement

Von Thorsten Poddig, Hubert Dichtl, Kerstin Petersmeier  
ePub | \*DOC | audiobook | ebooks | Download PDF



[Download](#)

[Read Online](#)

Produktinformation -Verkaufsrang: #1361249 in BcherVerffentlicht am: 2003-07-18Einband: Broschiert818  
Seiten | File size: 45.Mb

Von Thorsten Poddig, Hubert Dichtl, Kerstin Petersmeier : Statistik, konometrie, Optimierung. Methoden und ihre praktische Anwendung in Finanzanalyse und Portfoliomanagement before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Statistik, konometrie, Optimierung. Methoden und ihre praktische Anwendung in Finanzanalyse und Portfoliomanagement:

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen1 von 1 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich.  
Mathematisch-statistische Methoden fr BankerVon Jost W. KramerIm Rahmen der Entwicklung moderner

Banksteuerungsmethoden gewinnen statistische und konometrische Methoden zunehmend an Bedeutung. Gleichzeitig gehen die blichen Statistik-Lehrbcher nur am Rande auf die Interessen und Bedrfnisse von Bankern und Finanzanalysten ein. Diese Lcke schliet das vorliegende Buch, das ausdrcklich an den Bedrfnissen von Bankpraktikern ausgerichtet ist. Konzeptionell ist das Buch in drei Bereiche unterteilt, die mit Statistik, konometrie und Optimierung beschreiben sind. In ihrem Rahmen werden nicht nur die fr Bankfachleute bedeutsamen Methoden erlutert, sondern auch mit Hilfe von Fallstudien (CAPM-Konzept, Renditemessung, Risikooptimierung) als praktische Anwendung in der Praxis dargestellt. Die neue Auflage ist nicht nur um das Verfahren der Monte-Carlo-Simulation erweitert worden, sondern stellt verschiedene Formen von Hypothesentests vor. Auerdem wird gezeigt, wie sich mit Hilfe von Excel Regressionsanalysen durchfhren lassen. Dabei ist es den Autoren gelungen, das Buch - im Unterschied zu vielen Standardlehrbchern - auch und gerade fr Leser mit geringen Vorkenntnissen lesbar zu gestalten. Insgesamt ist das Buch eine gelungene Einfhrung in jene mathematisch-statistischen Methoden, die in der Banksteuerung zunehmend an Bedeutung gewinnen. Aufgrund seiner inhaltlichen und methodischen Gestaltung ist es nicht nur als Nachschlagewerk fr statistisch Vorbelastete" geeignet, sondern ermoglicht auch Bankpraktikern ohne grere Vorkenntnisse einen einfachen Zugang zu einer komplexen Materie. 2 von 2 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Notwendiges Methodenwissen fr das Asset Management Von Ein Kunde Sehr verstndliche Herleitung, der methodischen Hintergrnde, die im praktischen Asset Management bentigt werden. Besonders hilfreich sind die via Internet als Excel-Dateien mitgelieferten zahlreichen Anwendungsfille zur Portfoliooptimierung, Risikoanalyse, Performancemessung und, und, und... Ein wirklich gelungenes Buch! 1 von 1 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Ein Traum Von interessierter\_leser Dieses klasse aufgebaute Lehr-, Lern- und Arbeitsbuch sollte man sich nicht entgehen lassen. Stringent ist der Aufbau dieses Werkes mit den Teilbereichen Statistik, konometrie (Regressionsanalysen) und Optimierung. Als Krnung werden Excel-VBA-Programmcodes zur Umsetzung von praktischen Optimierungsfragen zur Verfugung gestellt. Der Autor stellt auf seiner Homepage umfangreiches Begleitmaterial zur Verfugung, wie Excel-Dateien und Folienstze. Es handelt sich hier nicht um ein klassisches Statistik-Lehrbuch, sondern um eine sehr gelungene Darstellung der statistischen Verfahren zur Finanzanalyse und zum Portfoliomanagement. Dieses Werk ist trotzdem jedem Studierenden der BWL/VWL/WiWi/WiSo zu empfehlen, da dieses Buch dazu fhrt, dass die statistischen Verfahren verstanden werden.

ber den Autor und weitere Mitwirkende Kerstin Petersmeier ist seit Oktober 1997 wissenschaftliche Mitarbeiterin am Lehrstuhl fr Finanzwirtschaft der Universitt Bremen. Sie studierte Mathematik mit den Schwerpunkten Statistik und Numerik und schloss 1997 an der Universitt Bremen das Studium ab. Im Rahmen ihrer Promotion beschftigt sich Frau Petersmeier mit der automatischen Modellierung und Prognose von Aktienkursen mit Hilfe von Jahresabschlussdaten.