

(Download free pdf) Finanzmarkt-konometrie: Basistechniken, Fortgeschrittene Verfahren, Prognosemodelle

Finanzmarkt-konometrie: Basistechniken, Fortgeschrittene Verfahren, Prognosemodelle

Von Schffer-Poeschel

ebooks / Download PDF / *ePub / DOC / audiobook



[Download](#)

[Read Online](#)

Produktinformation -Verkaufsrank: #895587 in BcherVerffentlicht am: 2002-02-07Abmessungen: 9.88 x 1.77b x 5.83l, Einband: Gebundene Ausgabe510 Seiten | File size: 64.Mb

Von Schffer-Poeschel : Finanzmarkt-konometrie: Basistechniken, Fortgeschrittene Verfahren, Prognosemodelle before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Finanzmarkt-konometrie: Basistechniken, Fortgeschrittene Verfahren, Prognosemodelle:

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen2 von 4 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Fr Praktiker hervorragend geeignet!!!Von AvicennaAuer Portfoliorisikomodellen, werden alle wichtigen Elemente zur mathematischen Analyse und Risikoanalyse des Finanzmarktes erklrt. Fokus der Leserschaft ist eindeutig der Anwender und Praktiker in Finanzinstituten.Der didaktische Gehalt hngt sehr stark vom Autor (der Autorin) ab, da

dieses Buch eine Zusammenstellung universitärer Papers sind. Für Praktiker sehr empfehlenswert!

Kurzbeschreibung Was sind typische Eigenschaften von Finanzmarkt-Zeitreihen? Mit welchen konometrischen Methoden kann man gute Prognosemodelle erstellen? Wie lässt sich das Kreditrisiko quantifizieren? Diese und weitere Fragen beantwortet das Fachbuch in acht Kapiteln. Der Methodenüberblick beginnt mit einer grundlegenden Darstellung von Regressionsanalyse und Zeitreihenverfahren. Darauf aufbauend werden fortgeschrittene Verfahren wie vektor-autoregressive Modelle und die Behandlung von nicht-stationären Zeitreihen erläutert. Spezielle Vertiefungen widmen sich der Modellierung stochastischer Volatilität und der Prognose von Kreditrisiken. Abschließend werden der Aufbau von Prognosemodellen und die Anwendung der verschiedenen konometrischen Methoden demonstriert. **Der Autor und weitere Mitwirkende** Dr. Michael Schröder ist Leiter des Forschungsbereichs "Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement" am Zentrum für Europäische Wirtschaftsforschung (ZEW) in Mannheim.