

(Úgy tudom ez csak azért kell, hogy a vizsgabizottság el tudja dönteni, hogy melyik tanárhoz kerüljön a szakdolgozat)

Kulcsszavak: implicit faktor modell, keresztmetszeti regresszió, faktorhozamok, faktorkitettségek, R^2 , p-érték, faktor index

Leírás: (max 500 karakter lehet)

A szakdolgozat az implicit faktor modellek témakörét tárgyalja. Az elméleti részben bemutatom a faktor modellek 3 típusát, valamint a keresztmetszeti és idősoros regresszió közti különbséget. A gyakorlati részben az S&P500 részvényeire építék egy modellt, meghatározom a faktorhozamokat, majd statisztikai eszközökkel elemzem a kapott eredményeket.

(351 karakter)