

Analiza vremenskih nizova zasnovana na kompleksnim mrežama

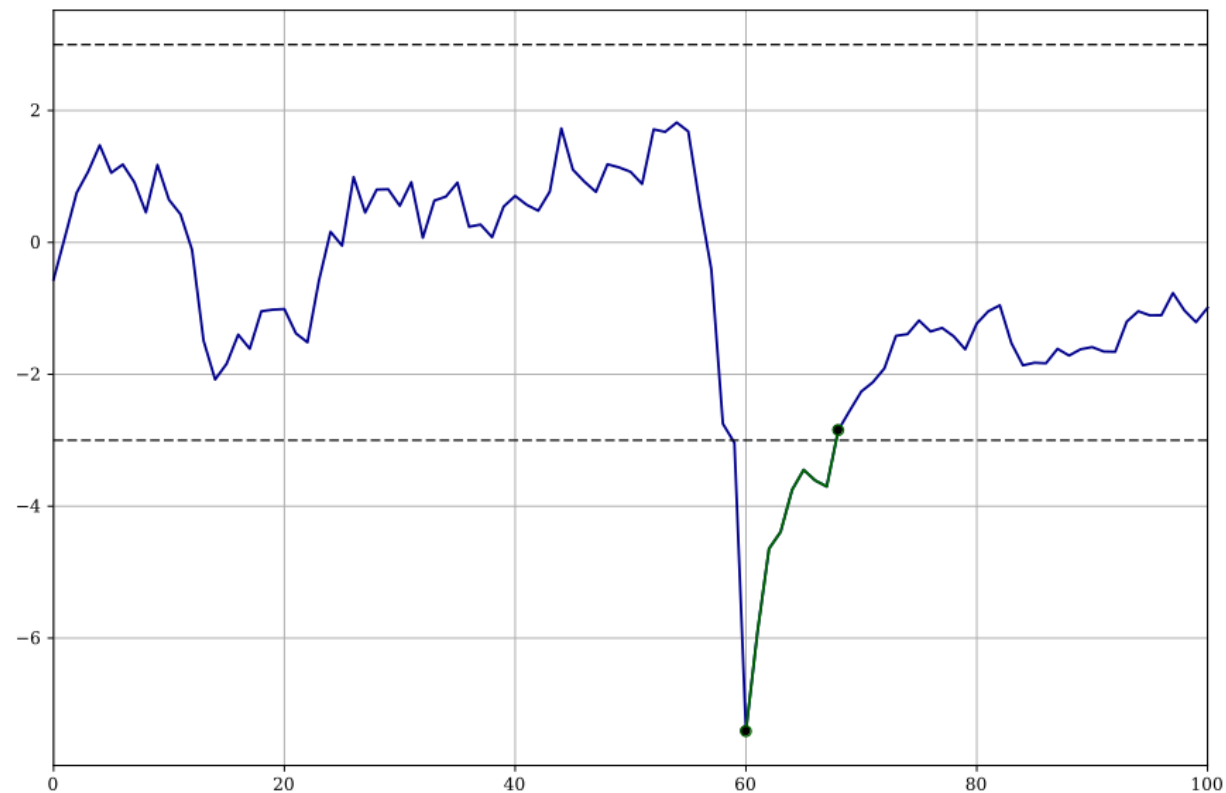
Autor: Lovre Mrčela

Mentor: Doc. dr. sc. Zvonko Kostanjčar

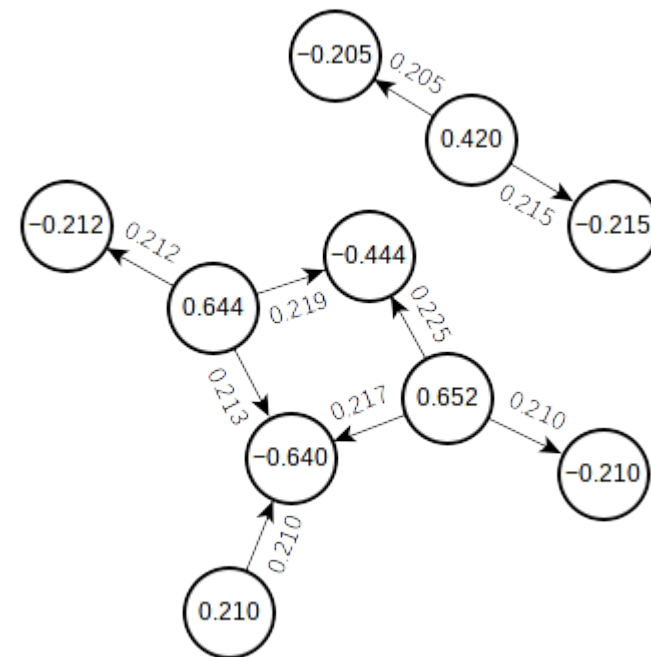
Sveučilište u Zagrebu
Fakultet elektrotehnike i računarstva
Zavod za elektroničke sustave i obradbu informacija

Cilj

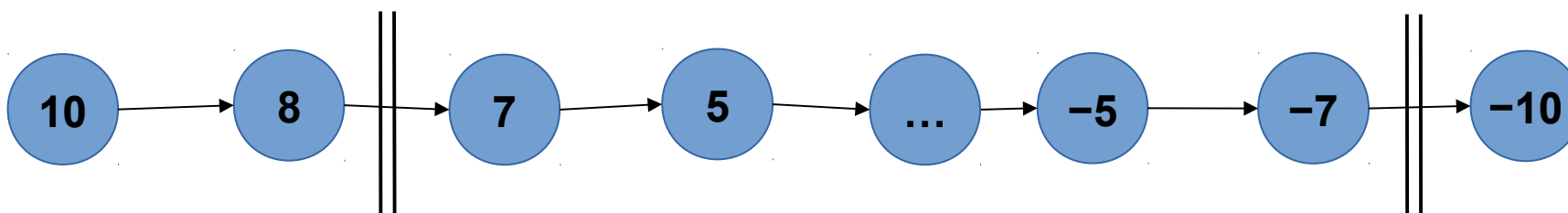
- optimizacija portfelja
- nedostatak statističke arbitraže: uzima u obzir samo parove vrijednosnica
- poboljšanje: uzeti u obzir ukupnu međusobnu interakciju svih vrijednosnica dobivenu na temelju statističke arbitraže



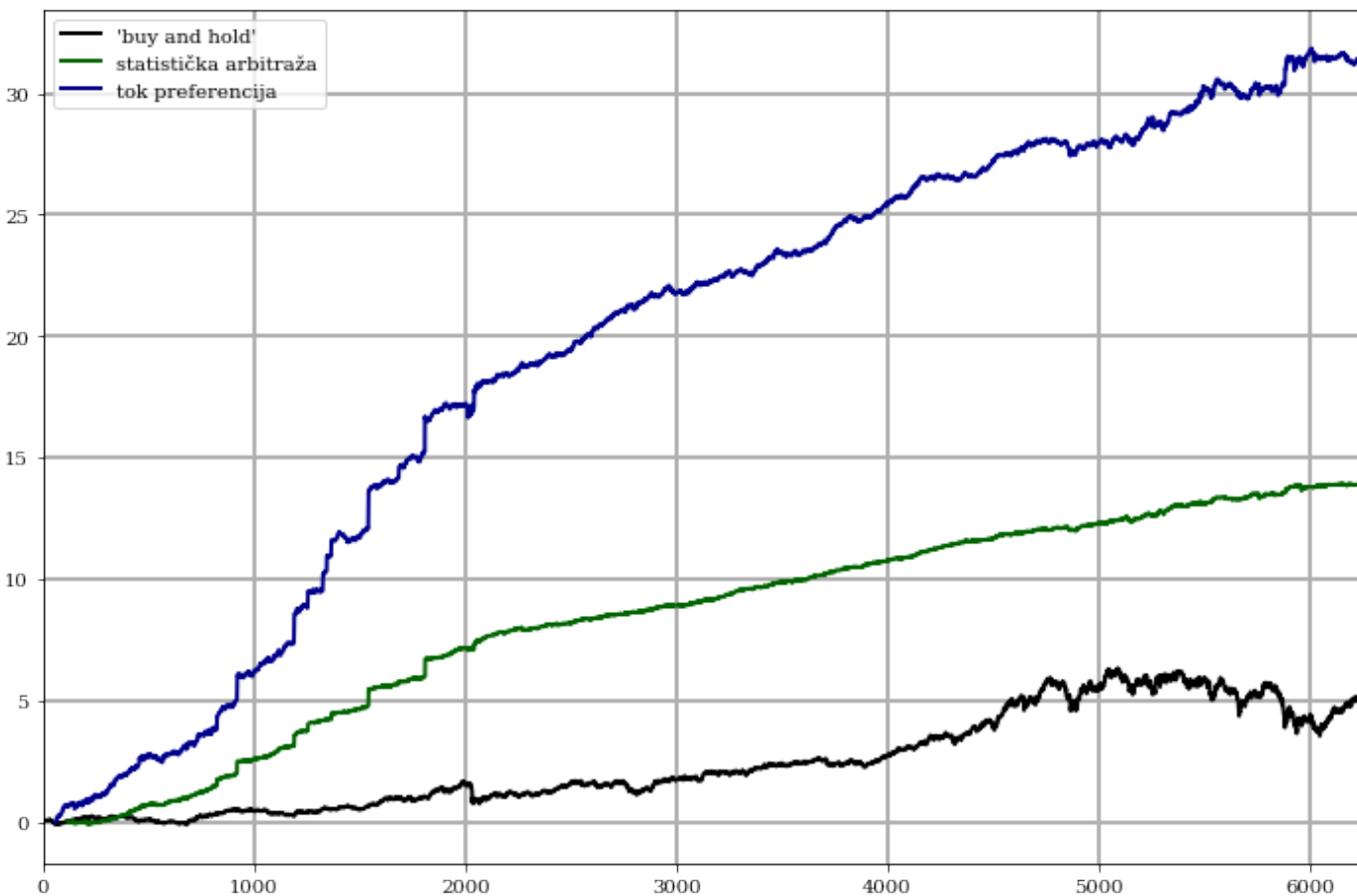
1. Statistička arbitraža



2. Graf toka preferencija



3. Metoda potencijala



<u>Metoda</u>	<u>'Buy and Hold'</u>	<u>Statistička arbitraža</u>	<u>Tok preferencije</u>
Godišnji povrat	0.07622	0.63033	1.28000
Volatilnost	0.15069	0.33532	0.78373
Sharpeov omjer	0.50582	1.87981	1.63322
Prosječni <i>turnover</i>	/	1.47321	0.55112
Ukupan profit, uz troškove trgovanja od 0.10%	5.49572	-2.74051	24.66204

Hvala na pažnji!