

Analiza vremenskih nizova zasnovana na kompleksnim mrežama

Autor: Lovre Mrčela

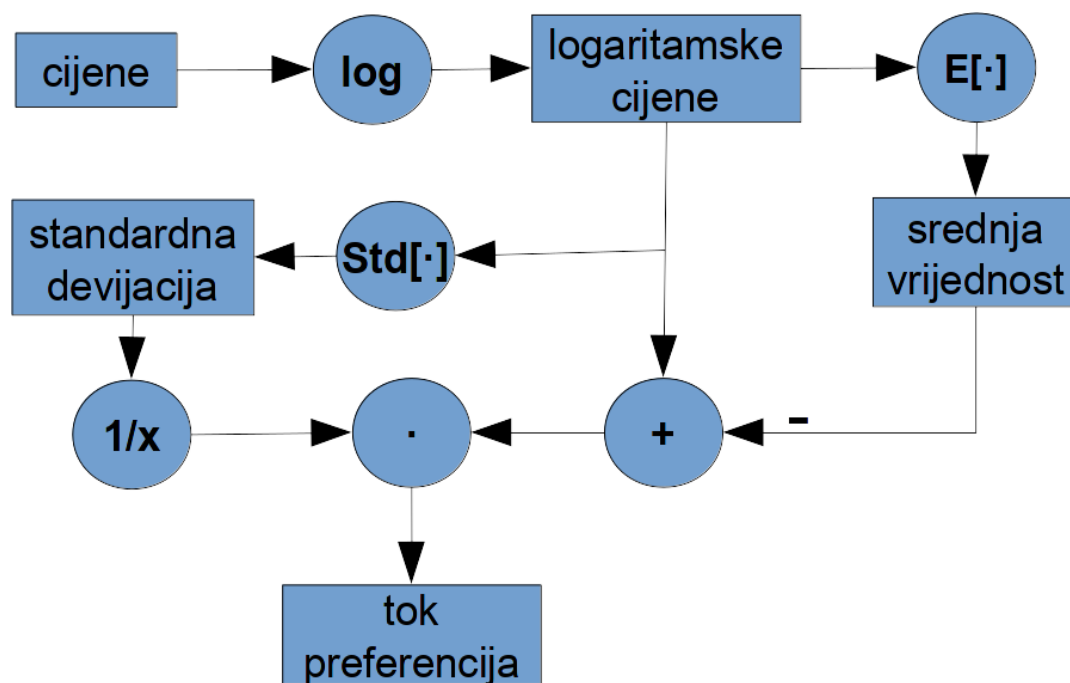
Mentor: Doc. dr. sc. Zvonko Kostanjčar

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

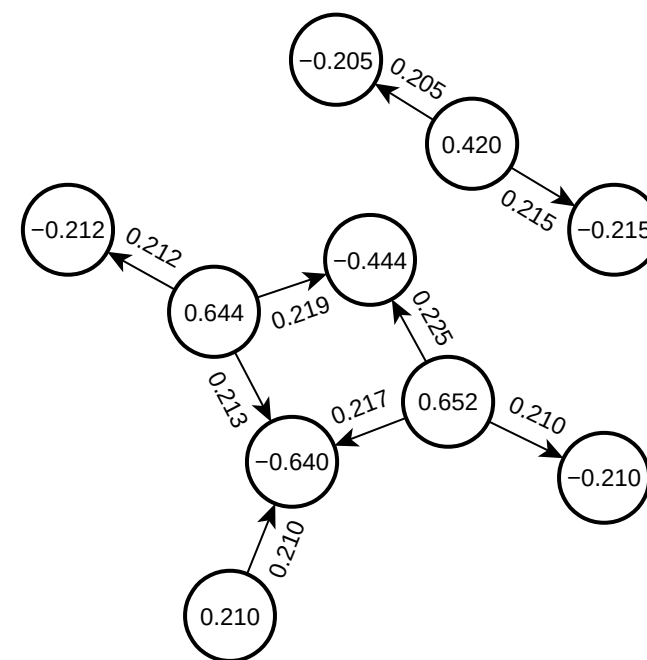
Problem

- 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

Metoda – tok preferencija

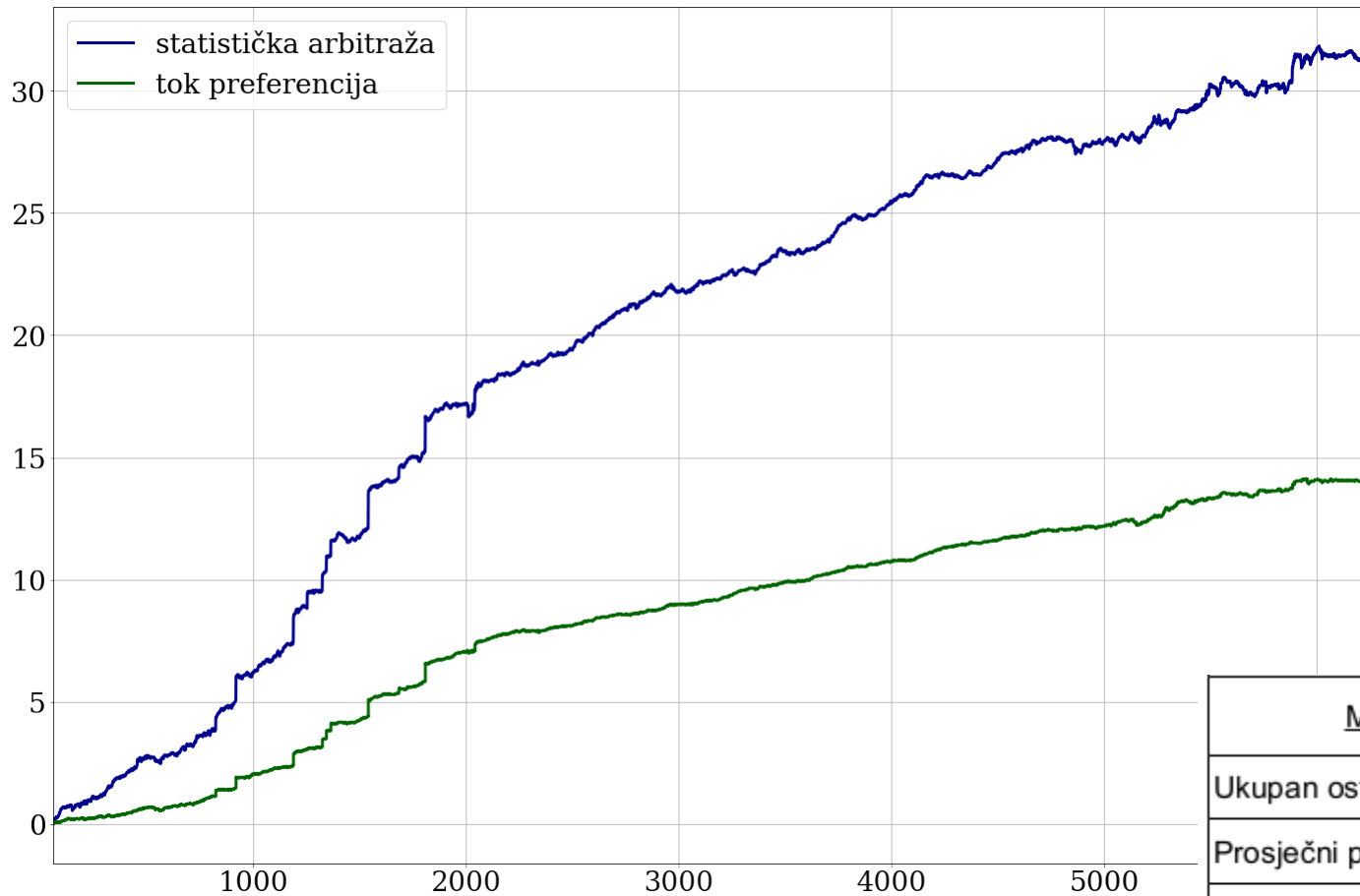


Izračun toka preferencija



Graf toka preferencija

Rezultati



Metoda	Statistička arbitraža	Tok preferencije
Ukupan ostvareni profit	13.99581	31.49704
Prosječni povrat	0.63033	1.00223
Volatilnost	0.33532	0.78363
Sharpeov omjer	1.87981	1.27896
Preciznost	0.56240	0.33241
Prosječni <i>turnover</i>	1.47321	0.55112
Ukupan profit, uz troškove trgovanja od 0.10%	-2.74051	24.66204

Hvala na pažnji!