

Analiza vremenskih nizova zasnovana na kompleksnim mrežama

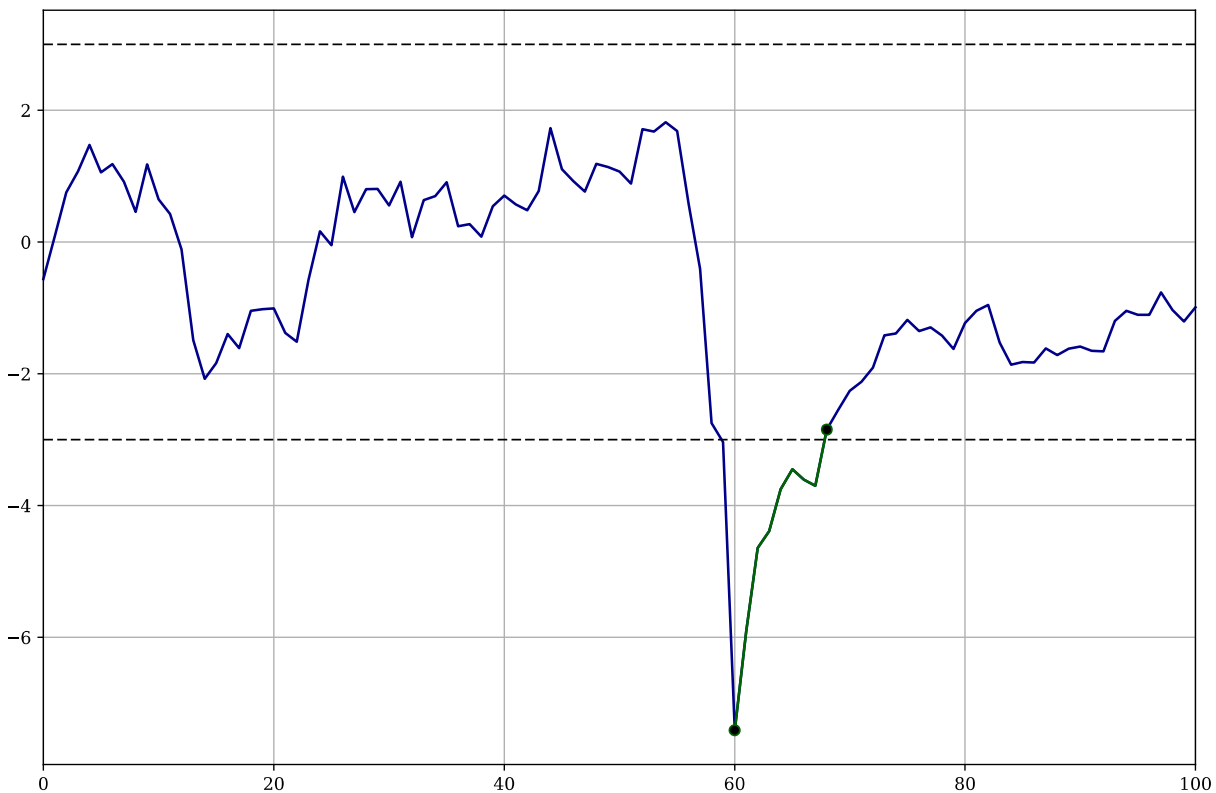
Autor: Lovre Mrčela

Mentor: Doc. dr. sc. Zvonko Kostanjčar

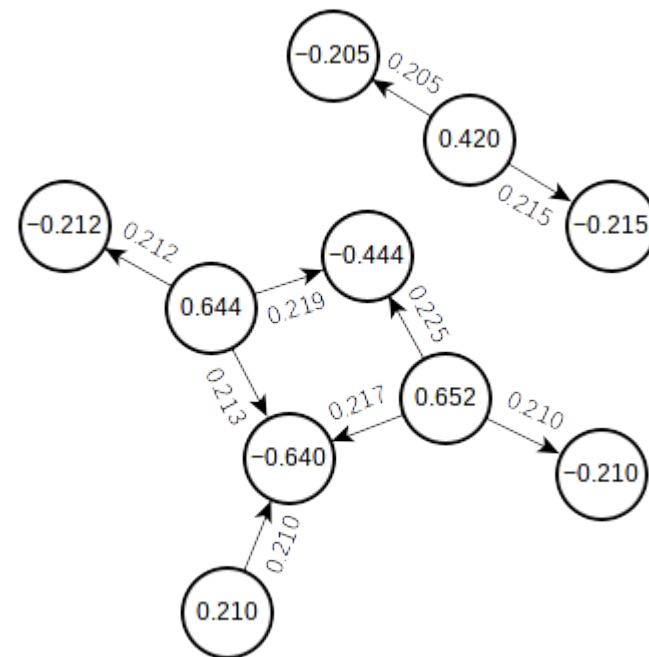
Sveučilište u Zagrebu
Fakultet elektrotehnike i računarstva
Zavod za elektroničke sustave i obradbu informacija

Cilj

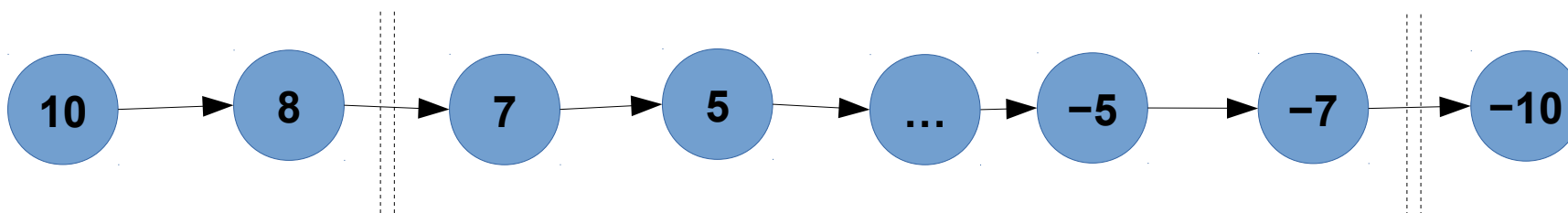
- optimizacija portfelja
- nedostatak statističke arbitraže: uzima u obzir samo parove vrijednosnica
- poboljšanje: uzeti u obzir ukupnu međusobnu interakciju svih vrijednosnica dobivenu na temelju statističke arbitraže



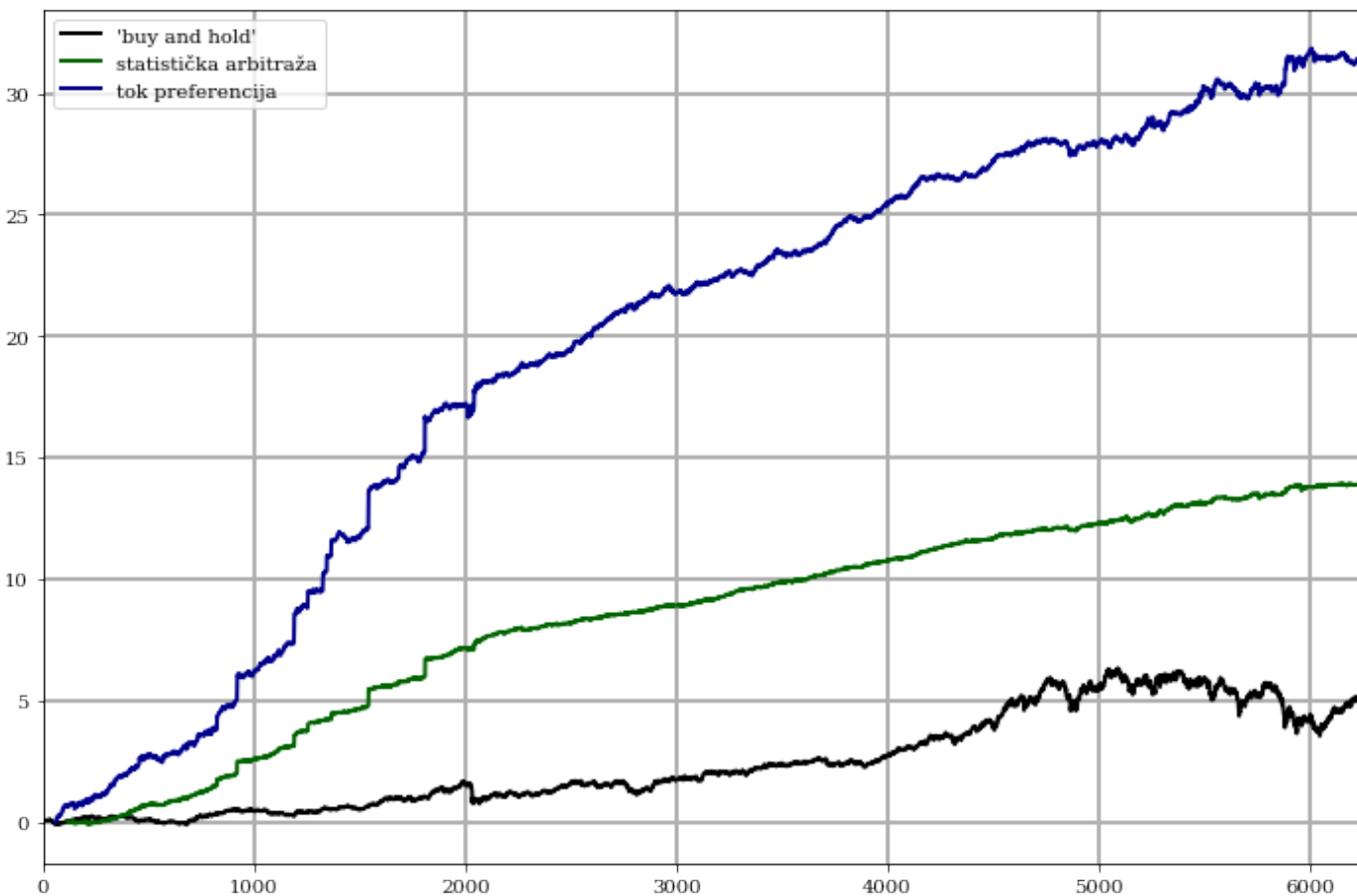
1. Statistička arbitraža



2. Graf toka preferencija



3. Metoda potencijala



Metoda	'Buy and Hold'	Statistička arbitraža	Tok preferencije
Prosječni povrat	0.07622	0.63033	1.00223
Volatilnost	0.15069	0.33532	0.78363
Sharpeov omjer	0.50582	1.87981	1.27896
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!