

25_Portfolios_5x5.csv: In diesem Dokument sind 25 Portfolios sortiert nach Marktkapitalisierung und dem Buchwert Eigenkapital zu Marktwert Eigenkapital (Book-to-Market Ratio). Diese Portfolios decken eine relativ große Variation in den Renditen ab und dienen daher als optimale "test assets" für Asset Pricing Modelle. Im optimalen Fall sollten die Asset Pricing Modelle die Renditen der 25 Portfolios statistisch erklären können. Die Renditen (gegeben in Prozent) sind bereits von Januar bis Dezember, auf jährliche Frequenz, aggregiert.

F-F-Annual.csv: In diesem Dokument sind die Fama French Faktoren (Markt-Faktor Mkt.RF, Size-Faktor SMB und Value-Faktor HML) und der risikolose Zinssatz (RF) in Prozent gegeben. Die Faktoren selbst sind Long-Short (Über)Renditen. RF können Sie z.B. verwenden, um die Überrenditen der 25 Fama French Portfolios zu berechnen. Die Faktoren (gegeben in Prozent) sind bereits von Januar bis Dezember, auf jährliche Frequenz, aggregiert.

consumption_growth_data.RData: In diesem R data frame ist das jährliche Konsumwachstum (von Quartal 4 bis Quartal 4, gemäß $c(t) / c(t-4) - 1$ berechnet) sowie das entsprechende Jahr gegeben.