

Obliczanie Współczynnika β

Wojciech Kłopotek, Wojciech Olejniczak

Czym jest β ?

Czym jest β ?

„Jak bardzo ruch ceny (zwrot) A wpłynie na cenę B?”

Czym jest β ?

Dla przykładu (dane z życia): AAPL (Apple) ma $\beta = 1.28$ w stosunku do NASDAQ

Jeżeli wartość NASDAQ wzrośnie o 10%, to statystycznie wartość APPL wzrośnie o 12.8%

Po co?

Po co?

Wycena produktów

Po co?

Wycena produktów

Ocena i minimalizacja ryzyka portfela

W czym problem?

W czym problem?

- Dane

W czym problem?

- Dane
- Obliczenia

W czym problem?

- Dane
- Obliczenia
- Frontend

Dane

File Edit Navigate Search Project Run Window Help

Project Explorer

com.ibm.cicsdev.beciapp.kc03h64.war

com.ibm.cicsdev.beciapp.kc03h64.warbu

com.ibm.cicsdev.resapp.kc03h64.bundle_1.

com.ibm.cicsdev.restapp.bundle_1.0.0

com.ibm.cicsdev.restapp.kc03h64.bundle_1

com.ibm.cicsdev.restapp.kc03h73.bundle_1

com.ibm.cicsdev.restfile.kc03h73.bundle_1.

mimuw.students2021.simplepoll.bundle_1.

My Favorites

z/OS UNIX Shells

MVS Files

Retrieved Data Sets

My Data Sets (KC03H64.*)

KC03H64.BETACICS.INPUT

INPUT1

INPUT2

INPUT3

INPUT4

INPUTCDP

INPUTWIG

KC03H64.BETACICS.JCL

BETACICS.cbl

BINDJCL.jcl

COMPJCL.jcl

KCSNCL.ircl

BetaResource.jav

CICSApplication.j

CICSInformation.j

CICSEnvironment.j

BetaResult.java

FrontResource.ja

InfoResource.jav

index.html

INPUT3

INPUTWIG

00001 -000.930000

00002 +000.310000

00003 +001.150000

00004 +001.320000

00005 +000.260000

00006 +000.060000

00007 -001.010000

00008 +000.320000

00009 -000.080000

00010 -001.390000

00011 -000.480000

00012 -000.800000

00013 +000.250000

00014 -000.380000

00015 -000.550000

00016 +001.400000

00017 +000.690000

00018 +000.650000

00019 +000.790000

00020 -001.030000

00021 +000.000000

00022 +000.660000

00023 +001.090000

00024 -000.280000

00025 -000.390000

00026 -000.400000

00027 -001.110000

00028 +000.490000

00029 -001.240000

00030 -000.130000

00031 +000.040000

00032 +000.140000

00033 -000.360000

00034 +000.290000

00035 000.400000

Markers Properties Data Source Explorer Snippets Console Remote Shell CICSplex Explorer JVM Servers Host Connections Program Definitions Bundles Bundle Definitions Programs File Definitions

CNX02111 Context: CICSTS52. Resource: BUNDLE. 2 records collected at 28 sty 2021, 09:21:28

Region	Name	Enable Status	Enabled Count	Availability	Bundle ID	Major Version	Minor Version	Micro Version	Install User ID	Install Time	Change User ID	Change Time
CICSTS52	BECIBUND	✓ ENABLED	1	NONE	com.ibm.cicsdev.bei	1	0	0	CICSUSER	2021-01-28 03:14:06	CICSUSER	2021-01-26 19:14:28
CICSTS52	MIMKK21	✓ ENABLED	1	NONE	mimuw.students20:	1	0	0	CICSUSER	2021-01-27 17:15:52	CICSUSER	2021-01-24 11:31:16

z Systems LPEX Editor

Insert31 : 1

Dane

Dane

- Zakładamy, że przygotowanie danych nie jest naszą odpowiedzialnością.

Dane

- Zakładamy, że przygotowanie danych nie jest naszą odpowiedzialnością.
- Mogą być ściągnięte z internetu ...

Dane

- Zakładamy, że przygotowanie danych nie jest naszą odpowiedzialnością.
- Mogą być pobrane z internetu ...
- ... Lub wygenerowane jako symulacja.

Prawdziwe dane

- Docelowe użycie aplikacji
- Ciężko stwierdzić, czy otrzymany wynik jest sensowny

Symulacja

- Daje pełną kontrolę nad parametrami
- Wiemy, jakiego wyniku się spodziewać

Obliczenia - COBOL

Obliczenia - usprawnienie

Obliczenia - uwaga

Trzeba uważać na precyzję reprezentacji liczb

Struktura aplikacji

- COBOL – logika
- Restowe API
- Frontend - HTML

Frontend – prezentacja na żywo

Dalszy rozwój?

- Wstępna obróbka danych
- Różne przedziały czasowe
- Analiza błędu

Dziękujemy za uwagę