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 β = 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

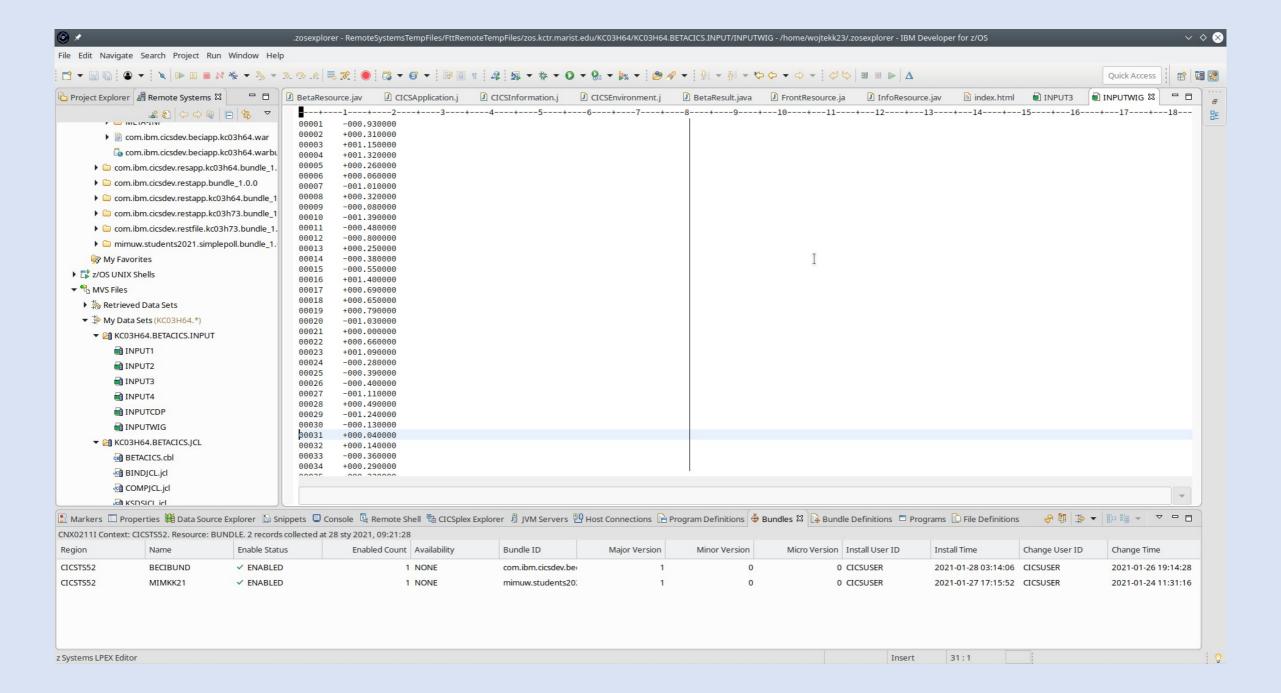
Po co?

Wycena produktów Ocena i minimalizacja ryzyka portfela

• Dane

- Dane
- Obliczenia

- Dane
- Obliczenia
- Frontend



 Zakładamy, że przygotowanie danych nie jest naszą odpowiedzialnością.

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

- 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