

Anlagestrategien für international diversifizierte Portfolios



Filesize: 1.48 MB

Reviews

An extremely wonderful publication with lucid and perfect reasons. It typically will not expense too much. You are going to like the way the blogger compose this publication.

(Prof. Maya Hand)

ANLAGESTRATEGIEN FÜR INTERNATIONAL DIVERSIFIZIERTE PORTFOLIOS



To read **Anlagestrategien für international diversifizierte Portfolios** PDF, remember to click the button listed below and save the file or have accessibility to additional information that are in conjunction with **ANLAGESTRATEGIEN FÜR INTERNATIONAL DIVERSIFIZIERTE PORTFOLIOS** ebook.

Diplom. De Mrz 1999, 1999. Taschenbuch. Book Condition: Neu. 210x148x7 mm. This item is printed on demand - Print on Demand Titel. Neuware - Diplomarbeit aus dem Jahr 1997 im Fachbereich BWL - Investition und Finanzierung, Note: 2,3, Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf (Unbekannt), Sprache: Deutsch, Abstract: Inhaltsangabe: Einleitung: Durch die Fixierung und den späteren Wegfall der Wechselkurse in der EWU entfallen bisherige Renditeunterschiede innerhalb der Union. Folglich hängt das zukünftige Renditeniveau von den entsprechenden Erwartungen der Finanzmärkte ab. Eine wesentliche Aufgabe der Wertpapieranlage besteht darin, eine Einschätzung über die erwarteten Erträge und Risiken der gesamten Investitionsmöglichkeiten abzugeben. Aus diesen Einschätzungen ist ein optimales Portfolio zu gestalten. Die Diplomarbeit befaßt sich zunächst mit der Portfoliotheorie - von den Anfängen bis hin zu der aktuellsten Post-Modern Portfolio Theory. Auf dieser Grundlage bieten die umfassenden anwendungsorientierten Weiterentwicklungen der Portfoliotheorien ausführliche und praxisnahe Informationen und Konsequenzen dieser Anlagestrategien im engeren Sinne. Im Anschluß daran wird eine empirische Analyse vorgestellt, welche Diversifikationsmöglichkeiten innerhalb einer Währungsunion untersucht und die Abhängigkeit von Wechselkursen bei der Portfoliokonstruktion exponiert. Die zahlreichen Praxisbezüge machen die Arbeit anschaulich und instruktiv. Inhaltsverzeichnis: INHALTSVERZEICHNIS I ABBILDUNGSVERZEICHNIS III ABKÜRZUNGSVERZEICHNIS IV SYMBOLVERZEICHNIS VI I. EINLEITUNG 1 II. THEORETISCHE FUNDIERUNG DES PORTFOLIO-MANAGEMENTS 2 A. GRUNDPRINZIPIEN 3 1. Investorverhalten 3 2. Renditeerwartung 4 3. Risikoperzeption 4 B. DAS PORTFOLIO SELECTION-MODELL VON MARKOWITZ 5 C. DAS INDEX-MODELL NACH SHARPE 9 D. DAS CAPITAL ASSET PRICING MODEL 11 1. Die Kapitalmarktklinie 11 2. Die Wertpapiermarktklinie 13 E. DAS ARBITRAGE PRICING MODEL 14 F. PERFORMANCEMESSUNG 15 1. Sharpe Ratio 16 2. Treynor-Maß 17 3. Jensen's Alpha 17 4. Appraisal Ratio 18 G. EFFICIENT UND COHERENT MARKET HYPOTHESES 18 H. POST-MODERN PORTFOLIO THEORY 20 1. Downside-Risikomaße 21 a) Ausfallwahrscheinlichkeit 22 b) Target Shortfall 23 c) Target Semivariance 23 2. Portfolio-Optimierung mit Downside-Risikomaßen 23 3. Sortino-Ratio 24 III. ANLAGESTRATEGIEN 25 A. STRATEGISCHE ASSET ALLOCATION 26 1. Anlagephilosophie 27 a) Passive Anlagestrategien 28 b) Aktive Anlagestrategien 30 (i) Qualitative Prognosen 31 (ii) Quantitative Prognosen 32 c) Benchmarkportfolios 34 (i) Problembereiche im passiven Portfolio-Management 35 (ii) Problembereiche im aktiven Portfolio-Management 36 2. Anlagestile 36 B. TAKTISCHE ASSET ALLOCATION 37 1. Risk Premium Strategy 39 2. Contrarian Strategy 39 C. DYNAMISCHE ASSET ALLOCATION 40 1. Optionen-Strategien 41 2. Dynamic Hedging 42 D. GLOBALE ASSET ALLOCATION 43 1. Internationale Diversifikation 43 2. Anlagephilosophie 47 3. Länderallokation 48 4. Währungsallokation 49 a) Diversifikation von Währungsrisiken 49 b) Hedging von Währungsrisiken 51 IV. EMPIRISCHE ANALYSE 52 A. ZIEL DER ANALYSE 52 B. METHODOLOGISCHE VORGEHENSWEISE 53 C. ERGEBNISSE...



Read Anlagestrategien für international diversifizierte Portfolios Online



Download PDF Anlagestrategien für international diversifizierte Portfolios



Download ePUB Anlagestrategien für international diversifizierte Portfolios

You May Also Like



[PDF] Psychologisches Testverfahren

Click the link listed below to download "Psychologisches Testverfahren" document.

[Download ePub »](#)



[PDF] Programming in D

Click the link listed below to download "Programming in D" document.

[Download ePub »](#)



[PDF] Grandpa Spanielson's Chicken Pox Stories: Story #1: The Octopus (I Can Read Book 2)

Click the link listed below to download "Grandpa Spanielson's Chicken Pox Stories: Story #1: The Octopus (I Can Read Book 2)" document.

[Download ePub »](#)



[PDF] Edge] the collection stacks of children's literature: Chunhyang Qiuyun 1.2 --- Children's Literature 2004(Chinese Edition)

Click the link listed below to download "Edge] the collection stacks of children's literature: Chunhyang Qiuyun 1.2 --- Children's Literature 2004(Chinese Edition)" document.

[Download ePub »](#)



[PDF] Yearbook Volume 15

Click the link listed below to download "Yearbook Volume 15" document.

[Download ePub »](#)



[PDF] Sarah's New World: The Mayflower Adventure 1620 (Sisters in Time Series 1)

Click the link listed below to download "Sarah's New World: The Mayflower Adventure 1620 (Sisters in Time Series 1)" document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] Oxford Reading Tree Read with Biff, Chip, and Kipper: Phonics: Level 2: The Red Hen (Hardback)**

Click the link beneath to get "Oxford Reading Tree Read with Biff, Chip, and Kipper: Phonics: Level 2: The Red Hen (Hardback)" PDF document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] Billy's Booger: A Memoir (sorta)**

Click the link beneath to get "Billy's Booger: A Memoir (sorta)" PDF document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] Access2003 Chinese version of the basic tutorial (secondary vocational schools teaching computer series)**

Click the link beneath to get "Access2003 Chinese version of the basic tutorial (secondary vocational schools teaching computer series)" PDF document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] A Dog of Flanders: Unabridged; In Easy-to-Read Type (Dover Children's Thrift Classics)**

Click the link beneath to get "A Dog of Flanders: Unabridged; In Easy-to-Read Type (Dover Children's Thrift Classics)" PDF document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] First Fairy Tales**

Click the link beneath to get "First Fairy Tales" PDF document.

[Download ePub »](#)

**[PDF] The Queen's Sorrow: A Novel**

Click the link beneath to get "The Queen's Sorrow: A Novel" PDF document.

[Download ePub »](#)