

Hausaufgabe

Abgabefrist: bei der Klausur (in der Prüfungszeit)

Artefakte die abgegeben werden müssen:

1. Ein Bericht von einigen Seiten DIN A4, Times New Roman 12; der Bericht muss keine Formeln, oder Definitionen/Erzählungen enthalten, sondern einfach die Vorgehensweise beschreiben und die Ergebnisse präsentieren
2. Die Excel/OpenOffice Datei mit den Berechnungen

Der Student muss in der Lage sein, einige kurze Fragen zu der Arbeitsweise zu beantworten.

Szenario:

Der Student wählt min. 3 Aktiengesellschaften von einem Markt. Die Kurse der Aktien am Ende des Tages werden für eine Periode von 2 Jahren (ca. $2 \cdot 250 = 500$) heruntergeladen. Zusätzlich wird auch der Marktindex für diese Periode heruntergeladen, und eine durchschnittliche Rendite der risikolosen Anlage wird auch berechnet.

Anforderungen:

1. Berechnet die logarithmischen täglichen Renditen für die Aktien und dem Marktindex. Berechnet die durchschnittliche tägliche Rendite.
2. Schätzt die Volatilität der täglichen Renditen mit Hilfe der Standardabweichung und der Varianz.
3. Schätzt die Beta-Koeffizienten für die Aktien.
4. Präsentieren Sie graphisch die Security Market Line und die 3 Aktien die Sie gewählt haben

Bewertung des Projektes:

- Form des Berichtes: 4 Pkt.
- Beantworten der Fragen: 5 Pkt.
- Aktienkurse herunterladen: 4 Pkt
- Jede der 4 Anforderungen: je 3 Pkt.