

ZMATH 2016e.00922

Brunner, Norbert; Kühleitner, Manfred

Estimating risks of losses. (Abschätzung von Verlustrisiken.)

Stoch. Sch. 36, No. 2, 20-24 (2016).

Zusammenfassung: Anleger kaufen und verkaufen regelmäßig Aktien oder Rohstoffe, um bei steigenden Kursen Gewinne zu erwirtschaften. Mit den Kursschwankungen ist aber auch ein Verlustrisiko verbunden, bis hin zum Bankrott. Dieser Artikel erklärt auf einfache Art, wie man dieses Marktrisiko eines Finanzproduktes aufgrund seiner historischen Wertentwicklung abschätzen kann. Dies ermöglicht einen elementaren Zugang bei gleichzeitiger realitätsnaher Verwendung großer Datenmengen.

Classification: K90 M30 M40

Keywords: stochastics; risks; financial mathematics; mathematical applications; risk management; stock exchange; value-at-risk; normal distribution; series of losses; series of profits; volatility; histograms; Q-Q plots; spread sheets; data analysis; real-life mathematics