

Portfolio, ANALYSE:

Contingent Claims	Wahrsch.	P(A)	P(B)
700 k ₁₃	0,3	0	0,2
800	0,2	0,04	0,03
900	0,1	0,23	0,09
1000	0	0,38	0,13
1100	0,1	0,31	0,19
1200	0,2	0,04	0,20
1300	0,3		0,33

symmetrisch

stochastisch
unverzerrt
6

UTAS:
 Kysteddy cyfnewid; Nid ydych chi gyswrtu'r ffordd;
 fforddys - 10%

$$\frac{70000 - 10000}{100} = -0,3$$

Portffolio A:

$$\bar{r} = r_1 \cdot f_1 + \dots + r_n \cdot f_n = -0,3 \cdot 0 + \dots + 0,3 + 0,09 =$$

$$A: \sigma = \sqrt{(r_1 - \bar{r})^2 \cdot f_1 + \dots + (r_n - \bar{r})^2 \cdot f_n} = 0,111 \rightarrow 11,1\%$$

$$= \sqrt{(-0,3 - 0,111)^2 \cdot 0 + \dots + (0,3 - 0,111)^2 \cdot 0,09} = 0,109 \rightarrow 10,9\%$$

Portffolio B:

$$\left(\begin{matrix} 0,111 \\ 0,109 \end{matrix} \right) \rightarrow 11,1\% \quad \sigma = 0,109 \cdot 100 = 10,9\%$$

↳ glücklicherweise:

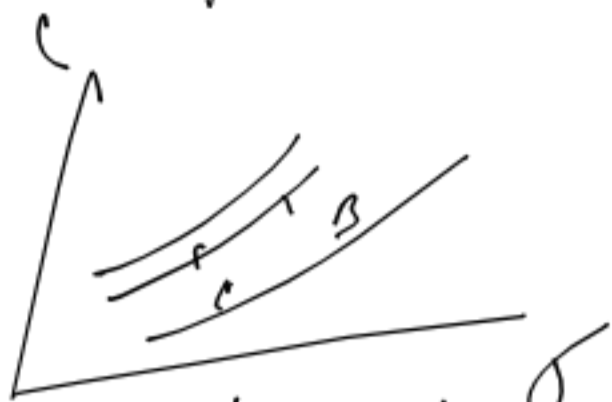
P_n mit guter Strukturierung existieren
als $\sum_{i=1}^n \text{Wert}_i$

(kann man perf. machen)

GP (HAD) Struktur mit z_i : \rightarrow Wert z_i auch z_i ...
$$\sigma = \frac{\sqrt{z_1^2 + \dots + z_{T-1}^2}}{T-1}$$

In di praktikum' fisika (mekanika):

$i \circledast \text{spray}'_v(\sigma, i)$

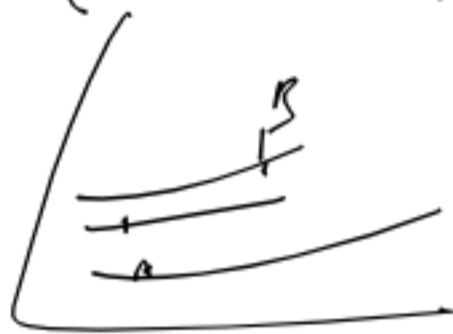


kontinuitas

dan

linieritas

terjadi

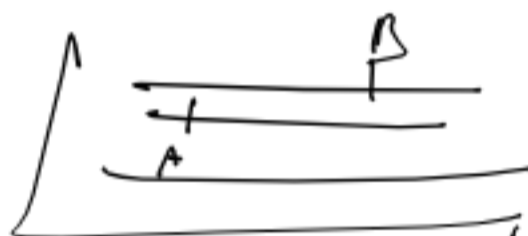


PADA' ALG-K20



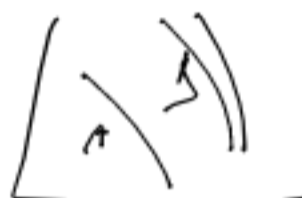
terjadi

anulus



kontinuitas

tidak terjadi



terjadi

kontinuitas

