

(Ebook pdf) Kapitalmarkt Und Zeitkontinuierliche Bewertung (Betriebswirtschaftliche Studien)

Kapitalmarkt Und Zeitkontinuierliche Bewertung (Betriebswirtschaftliche Studien)

Von Rainer Schöbel

DOC | *audiobook | ebooks | Download PDF | ePub



DOWNLOAD



+

READ ONLINE

Produktinformation -Verkaufsrank: #9251294 in BcherVerffentlicht am: 2013-10-04Erscheinungsdatum: 2013-10-04Abmessungen: 9.25 x .60b x 6.10l, .0 Pfund Einband: Taschenbuch264 Seiten | File size: 54.Mb

Von Rainer Schöbel : Kapitalmarkt Und Zeitkontinuierliche Bewertung (Betriebswirtschaftliche Studien) before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Kapitalmarkt Und Zeitkontinuierliche Bewertung (Betriebswirtschaftliche Studien):

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen0 von 0 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Arg Theoretisch...aber dafr schn generellVon CorMagSchade, dass das Bchlein nur noch schwer zu erhalten ist. Arbitrage-

und Gleichgewichtsbetrachtung zur Bewertung von contingent claims werden hier gegenüber gestellt und die konzeptionellen Unterschiede bezüglich der Methodik und der zugrundeliegenden Annahmen beleuchtet. Alles in teilweise etwas unverständlicher Matrizenschreibweise (jede Brownsche Bewegung ist hier gleich mehrdimensional und jede Volatilität eine zeitabhängige Varianz-Kovarianz matrix) Wenn man mit der Notation aber mal warm geworden ist, bietet das Buch eine elegante Formulierung der Erkenntnisse der Optionsbewertung, die an Generalität kaum zu überbieten ist. Eine sehr theoretische Betrachtung des Themas und kein Textbook. Pro/Kontra: Pro- Gegenüberstellung von Gleichgewicht und Arbitrage- eine Betrachtung des Problems aus der Sicht eines ökonomischen, sehr theoretisch- elegante Schreibweise (ich meine die mathematische Schreibweise)- sehr generell gehalten- günstig im Preis Contra- Texte teilweise etwas anstrengend "akademisch" gehalten- sehr Differentialgleichungs-lastig. Martingal-Ma Ansatz nicht in der selben Tiefe behandelt, wie der Rest- kein direkter Praxisbezug Fazit: Gutes Buch. Kein Text Book. Mehr Ökonomie als financial engineering.

Kurzbeschreibung Dieses Buch bietet eine Gesamtschau des gegenwärtigen Theoriegebüdes zeitkontinuierlicher Bewertung. Das Grundmotiv besteht dabei in der Konfrontation des modernen Arbitrageansatzes mit der älteren Tradition ökonomischen Denkens in Gleichgewichten. Als Medium dient das zeitkontinuierliche Modell, da es in gegenwärtig unübertroffener Weise gestattet, gleichzeitig Dynamik und Risiko ökonomisch relevanter Einflüsse bei der Bewertung finanzieller Ansprüche zu modellieren. Im Ergebnis wird dem Leser ein umfassender Modellrahmen für die unterschiedlichsten zeitkontinuierlichen Bewertungsprobleme angeboten. Neben arbitrageorientierter und gleichgewichtsorientierter Bewertung wird ein dritter Weg, individuelle Bewertung in unvollkommenen Märkten, aufgezeigt. Dabei wird auch auf Probleme der Parameterbestimmung detailliert eingegangen.