

bietet leicht verständliche Risiko-Rendite-Zeit-Kennzahlen in jeder Referenzwährung für die traditionelle Anlageberatung, digitale Beratungsangebote und die Einhaltung aufsichtsrechtlicher Anforderungen.

Demo Tool

Risiko-Rendite-Schätzungen für eine weltweite Auswahl Aktien, Fonds und Indices in ihrer Referenzwährung und in CHF für einen Schätzhorizont vom 1. August 2015 - 31. Juli 2016. Das Demo Tool erlaubt keine Auswahl der Schätzmethode beziehungsweise komplexer Produkte.

Schätzmethodik

Verfahren: Geometrische Brownsche Bewegung

Schätzpfade: 10.000

Datenhorizont: Januar 2010 - Juli 2015

Installation

fairvalues[©] benötigt die Matlab Compiler Runtime (MCR) in der Version 8.3. Diese kann kostenlos für Windows und Mac unter

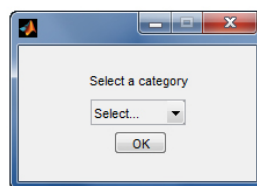
<http://de.mathworks.com/products/compiler/mcr/?refresh=true>

heruntergeladen werden. Eine Matlab Lizenz wird nicht benötigt. Nach erfolgreichem Download des MCR, den Installer öffnen und den MCR Installationshinweisen folgen. Stellen Sie sicher, dass Ihre Sicherheitseinstellungen Installation fremder Anwendungen zulässt.

Demo Tool starten

Kopieren Sie den Demo Tool Ordner auf Ihren PC. Der Zielordner ist frei wählbar. Öffnen Sie den Ordner und starten Sie die Anwendung mit einem Doppelklick.

Die Initialisierung kann einige Sekunden dauern. Es öffnet sich zuerst eine Kategorie-Liste. Nach Auswahl der Kategorie können darin enthaltene Titel in verschiedenen Referenzwährungen selektiert werden.

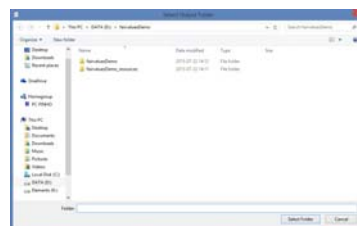


Auswahl Kategorie



Auswahl Titel

Wählen Sie einen Titel aus und klicken Sie auf OK. Es öffnet sich ein letztes Auswahlfenster. Wählen Sie hier einen Zielordner aus in dem die Schätzergebnisse gespeichert werden sollen und bestätigen Sie die Auswahl.



Auswahl Ergebnisordner

Im Anschluss öffnen sich 4 Graphiken: Graphik 1 und Graphik 2 zeigen die zeitliche Entwicklung verschiedener Risiko-Rendite-Kennzahlen. Graphik 3 stellt die Verteilung der geschätzten Rendite am 31. Juli 2016 graphisch dar und Graphik 4 zeigt die 2D Bewertung des Titels basierend auf der mittleren Rendite und des zu erwartenden Risikos.

Ergebnisse werden in tabellarischer und graphischer Form im Zielordner gespeichert.