



Hans-Peter Deutsch

### **Quantitative Portfoliosteuerung**

Konzepte, Methoden, Beispielrechnungen

X, 246 S., zahlreiche Abbildungen und Rechenmodelle, Inkl.

CD-ROM, Gebunden

Preis: EUR 49,95 / CHF 77,00

Erschienen am: 04.08.2005

ISBN: 3-7910-2402-7

ISBN: 978-3-7910-2402-8

lieferbar

#### **Highlights:**

Leitfaden mit der wegweisenden neuen Kennzahl "Deutsch Ratio"

Alle Kennzahlen der modernen Portfolioanalyse

Inklusive CD-ROM mit Beispielrechnungen

Anhang mit Grundlagen zur Wahrscheinlichkeitsrechnung, Statistik und Stochastik

#### **Inhalt:**

Sinnvolle Investitionsentscheidungen sind nur möglich durch bewusste Übernahmen von Risiken. Eine konsistente Quantifizierung und ein effizientes Management dieser Risiken sind hierfür unabdingbar. Der Autor erläutert, wie Risiken mit modernen Konzepten wie Value at Risk oder Expected Shortfall quantifiziert werden können. Darauf aufbauend werden mathematisch-statistische Methoden der Portfoliooptimierung unter Berücksichtigung der Risiken vorgestellt und anhand von Beispielpportfolios auf der beiliegenden CD-ROM explizit gerechnet. Außerdem werden alle Kennzahlen der modernen Portfolioanalyse, von "Alpha" und "Beta" bis zu "Tracking Error" und "Information Ratio" präzise definiert und Methoden zu ihrer Berechnung dargelegt.

#### **Urheber:**

Dr. Hans-Peter Deutsch ist Geschäftsführer und Gründer der d-fine GmbH, Frankfurt a.M., eines der renommiertesten deutschen Beratungsunternehmen für die Finanzindustrie im quantitativen und systemtechnischen Bereich. Darüber hinaus ist er Gastprofessor an der Universität Oxford, England, und "Member of the Advisory Board" für das Finanzmathematik-Programm der Universität Oxford. Weiterhin ist er Vorsitzender des Beirats des Finanzmathematik-Instituts an der Johann Wolfgang Goethe-Universität in Frankfurt am Main.

#### **Pressestimmen:**

"fachlich einwandfreie und hochwertige Behandlung des komplexen Themas" BankArchiv, Wien

Hans-Peter Deutsch erläutert in seinem Buch, wie Risiken mit modernen Konzepten wie Value at Risk oder Expected Shortfall quantifiziert werden können... Creditreform

Das Buch zeigt, wie Risiken gemessen und gemanagt werden können und darauf aufbauend eine

Optimierung von Portfolios durchgeführt werden kann. Absolutreport

**Systemvoraussetzungen:**

Windows 98/ME/NT 4.0/XP, Microsoft Excel

## Fax-Bestellung (0711) 21 94-119

Bitte liefern Sie mir gegen Rechnung (zzgl. Versandkosten)



Hans-Peter Deutsch,

**Quantitative Portfoliosteuerung**

EUR 49,95 / CHF 77,00  
ISBN 3-7910-2402-7  
ISBN 978-3-7910-2402-8

Schäffer-Poeschel Verlag  
Vertrieb  
Werastraße 21-23

70182 Stuttgart

---

Name, Vorname

---

Firma, Funktion

---

Straße, Hausnummer

---

PLZ, Ort

---

Telefon, Email

---

Datum, Unterschrift