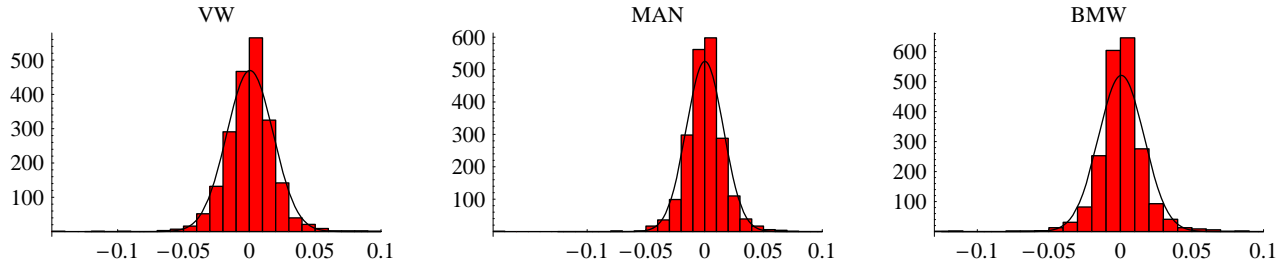


Kap. 2.8:

korrigierte Histogramme der Renditen:



(Möchte man Wahrscheinlichkeits- bzw. Dichtefunktionen darstellen, müsste man anstelle der absoluten Häufigkeiten die prozentuellen Häufigkeiten bzw. die prozentuellen Häufigkeiten, dividiert durch die Klassenbreite, plotten.)

korrigierte Risikoprofile der Renditen:

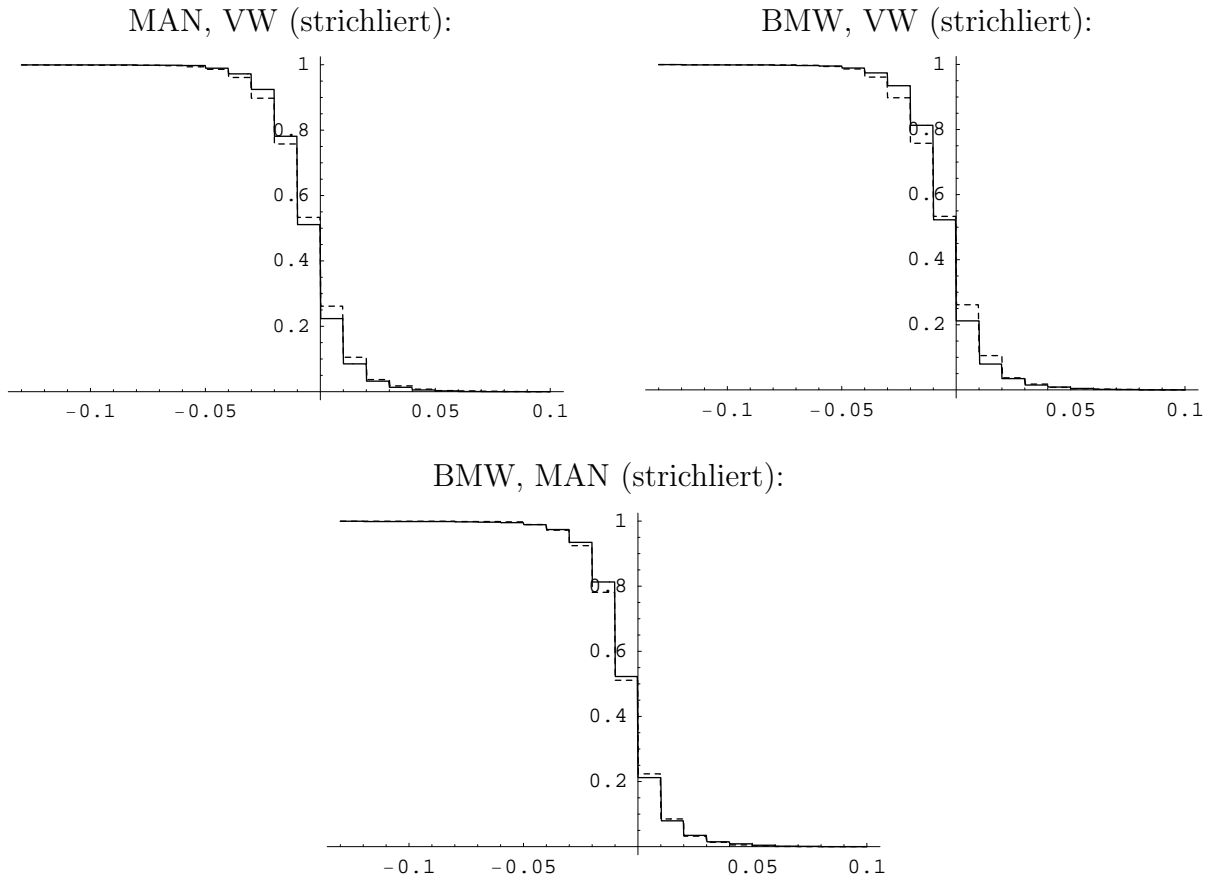


Tabelle S.46:

Klasse	VW		NV	MAN		NV	BMW		NV
	Hfk.	kum.	kum.	Hfk.	kum.	kum.	Hfk.	kum.	kum.
$\leq -0.12$	1	0.05%	0.00%	1	0.05%	0.00%	1	0.05%	0.00%
$] -0.12, -0.11]$	1	0.10%	0.00%	0	0.05%	0.00%	2	0.14%	0.00%
$] -0.11, -0.10]$	0	0.10%	0.00%	0	0.05%	0.00%	0	0.14%	0.00%
$] -0.10, -0.09]$	1	0.14%	0.00%	0	0.05%	0.00%	0	0.14%	0.00%
$] -0.09, -0.08]$	0	0.14%	0.00%	0	0.05%	0.00%	0	0.14%	0.00%
$] -0.08, -0.07]$	0	0.14%	0.00%	2	0.14%	0.00%	2	0.24%	0.00%
$] -0.07, -0.06]$	3	0.29%	0.03%	0	0.14%	0.01%	2	0.34%	0.01%
$] -0.06, -0.05]$	7	0.63%	0.21%	2	0.24%	0.08%	3	0.48%	0.07%
$] -0.05, -0.04]$	16	1.39%	1.10%	17	1.06%	0.55%	13	1.11%	0.54%
$] -0.04, -0.03]$	52	3.89%	4.23%	36	2.79%	2.82%	31	2.60%	2.73%
$] -0.03, -0.02]$	132	10.24%	12.32%	99	7.55%	10.11%	82	6.54%	9.77%
$] -0.02, -0.01]$	291	24.23%	27.66%	298	21.88%	26.03%	253	18.70%	25.23%
$] -0.01, 0.00]$	467	46.68%	48.92%	562	48.89%	49.63%	604	47.74%	48.42%
$] 0.00, 0.01]$	565	73.85%	70.51%	598	77.64%	73.35%	646	78.80%	72.17%
$] 0.01, 0.02]$	325	89.47%	86.54%	288	91.49%	89.55%	276	92.07%	88.79%
$] 0.02, 0.03]$	142	96.30%	95.26%	110	96.78%	97.06%	93	96.54%	96.73%
$] 0.03, 0.04]$	40	98.22%	98.74%	39	98.65%	99.42%	41	98.51%	99.32%
$] 0.04, 0.05]$	21	99.23%	99.75%	17	99.47%	99.92%	13	99.13%	99.90%
$] 0.05, 0.06]$	9	99.66%	99.96%	6	99.76%	99.99%	9	99.57%	99.99%
$] 0.06, 0.07]$	2	99.76%	100.00%	4	99.95%	100.00%	6	99.86%	100.00%
$] 0.07, 0.08]$	2	99.86%	100.00%	1	100.00%	100.00%	1	99.90%	100.00%
$] 0.08, 0.09]$	2	99.95%	100.00%	0	100.00%	100.00%	2	100.00%	100.00%
$] 0.09, 0.10]$	1	100.00%	100.00%	0	100.00%	100.00%	0	100.00%	100.00%
$> 0.10$	0	100.00%	100.00%	0	100.00%	100.00%	0	100.00%	100.00%
Summe	2080			2080			2080		

Abkürzungen: Hfk. = Häufigkeit, kum. = kumuliert

Die Spalte „NV kum.“ gibt die kumulierte Normalverteilung mit gleichem Mittelwert und gleicher Standardabweichung wie die Verteilung der jeweiligen Aktienrenditen an.