clear

cd C:\EigeneDateien\FH\Finance\Angewandte\Daten

capture log close

log using fonds\_performance.log, replace

set more off

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Achtung Treynor Mazuy Ansatz mit Dax als Benchmark\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Datenaufbereitung 3 Fonds\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

use fonds\_3bsp, clear

gen date=ym(jahr, monat)

xtset wkn date, monthly

sum

replace dafox\_ren= dafox\_ren\*100

replace dax\_ren= dax\_ren\*100

replace ir\_90tage=ir\_90tage\*100

gen fond\_ren= 100\*(ln(price)- ln(L.price))

gen fond\_ren\_er= fond\_ren-ir\_90tage

gen dax\_ren\_er= dax\_ren-ir\_90tage

gen dafox\_ren\_er = dafox\_ren-ir\_90tage

gen dax\_ren\_er\_2 = dax\_ren\_er^2 /\*Achtung Treynor Mazuy Ansatz\*\*/

gen dafox\_ren\_er\_2 = dafox\_ren\_er^2 /\*Achtung Treynor Mazuy Ansatz\*\*/

gen dax\_dum = dax\_ren\_er>0 & dax\_ren\_er ~=. /\* Missing values sind die gr��ten Zahlen\*/

gen dax\_ren\_er\_dum =dax\_dum \* dax\_ren\_er /\*Achtung Henriksson Merton Ansatz\*\*/

gen dafox\_dum = dafox\_ren\_er>0 & dafox\_ren\_er ~=. /\* Missing values sind die gr��ten Zahlen\*/

gen dafox\_ren\_er\_dum =dafox\_dum \* dafox\_ren\_er /\*Achtung Henriksson Merton Ansatz\*\*/

by wkn: sum fond\_ren, detail

sum dax\_ren dafox\_ren ir\_90tage, detail

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Analyse Wertpapier 847160\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Normale t-Werte\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

regress fond\_ren\_er dax\_ren\_er if wkn== 847160

predict resid, residuals

tsline resid

rvfplot

estat dwatson

/\* �berpr�fung der Annahme nicht vorhandener Autokorrelation der St�rterme\*/

estat bgodfrey, small lags(1/2)

/\* �berpr�fung der Annahme nicht vorhandener Autokorrelation der St�rterme\*/

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

/\* �berpr�fung der Annahme der Homoskedastizit�t der St�rterme, iid bedeutet keine NV der St�rterme notwendig\*/

drop resid

regress fond\_ren\_er dafox\_ren\_er if wkn== 847160

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/2)

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

/\*Achtung Treynor Mazuy Ansatz\*\*/

regress fond\_ren\_er dax\_ren\_er dax\_ren\_er\_2 if wkn== 847160

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/2)

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

regress fond\_ren\_er dafox\_ren\_er dafox\_ren\_er\_2 if wkn== 847160

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/2)

estat hettest dax\_ren\_er dax\_ren\_er\_2, rhs iid

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Analyse Wertpapier 848550

\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

/\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*Normale t-Werte\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*\*/

regress fond\_ren\_er dafox\_ren\_er if wkn== 848550

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/3)

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

\*predict yhat

regress fond\_ren\_er dafox\_ren\_er dafox\_ren\_er\_2 if wkn== 848550

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/3)

estat hettest dax\_ren\_er dax\_ren\_er\_2, rhs iid

/\* Henriksson Merton Ansatz\*/

regress fond\_ren\_er dafox\_ren\_er dafox\_ren\_er\_dum if wkn== 848550

rvfplot

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/2)

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

regress fond\_ren\_er dax\_ren\_er dax\_ren\_er\_dum if wkn== 848550

rvfplot

estat dwatson

estat bgodfrey, small lags(1/2)

estat hettest dax\_ren\_er, rhs iid

/\*