

Hoofdstuk 11

1. Waar staan b_1 en b_0 voor in een least squares regressielijn?

b_1 staat voor de helling en b_0 staat voor de intersectie met de y-as.

2. Welke onderdelen zitten er in de analyse van variantie?

Sum of squares total, sum of squares error en sum of squares regression.

3. Wat zegt de determinatiecoëfficiënt over de regressie?

Een hogere waarde staat voor een betere regressie

4. Van welke twee hoeveelheden is de variantie van de helling coëfficiënt afhankelijk?

De afstand van de punten op de regressielijn en de totale afwijking van de X waarden van het gemiddelde.

5. Wanneer kunnen regressiemodellen worden gebruikt bij het voorspellen van de afhankelijke variabele?

Als de toekomstige waarde van de onafhankelijke variabele gegeven is.

6. Wat voor een gevolg heeft een wijdere interval?

Hoe wijder de interval, hoe groter de onzekerheid rondom de puntvoorspelling.

7. Welke drie hoeveelheden hebben invloed op de voorspelling en betrouwbaarheid intervallen en op welke manier?

Hoe groter s_e^2 , hoe groter de voorspelling interval en de betrouwbaarheidsinterval.

Hoe groter de steekproefomvang n , hoe smaller de voorspelling interval en de betrouwbaarheidsinterval.

Hoe groter de dispersion, hoe meer informatie, hoe preciezer de schatting.

8. Wat is het verschil tussen diversifiable risico en nondiversifiable risico?

Diversifiable risico is het risico verbonden aan specifieke bedrijven en industrieën.

Non diversifiable risico is het risico verbonden aan de gehele economie.

9. Noem 3 voorbeelden van diversifiable risico.

Werk conflicten, nieuwe concurrentie, consumentenmarkt veranderingen.

10. Hoe kan het diversifiable risico gecontroleerd worden?

Door een groter portfolio en door het opnemen van waarvan het rendement een negatieve correlatie kent.

11. Wat geeft de beta coëfficiënt aan?

Hoe afhankelijk het rendement van een bepaald bedrijf is van het gehele markt rendement.

12. Wat betekent het als de beta coëfficiënt 1 is?

Dan volgt het rendement van een bedrijf precies de markt.

13. Hoe weet je of het rendement van een bedrijf heftiger reageert op de markt?

Als de beta meer dan 1 is.

14. Uit welke onderdelen bestaat de required return op een investering?

Risk-free rate, beta for investment en market return.

15. Wat zijn extreme punten?

Punten die X waarden hebben die substantieel afwijken van de X waarden van andere punten.

16. Wat zijn outlier punten?

Punten die substantieel afwijken in de Y richting van de voorspelde waarde.