

DIE STANDARDABWEICHUNG ALS SCHLÜSSEL ZUM RISIKOMANAGEMENT

Gleichung 1: Berechnung der Abweichung vom Erwartungswert für jeden Wert der Zeitreihe

$$x_i - \bar{x}$$

Gleichung 2: Quadrierung der Abweichungen vom Erwartungswert

$$(x_i - \bar{x})^2$$

Gleichung 3: Summierung der Abweichungen vom Erwartungswert

$$\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

Gleichung 4: Berechnung der Varianz

$$\sigma^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$$

Gleichung 5: Berechnung der Standardabweichung

$$\sigma = \sqrt{\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}$$