

Themen Bachelor-Abschlussarbeiten im FSS 2020 (Wirtschaftspädagogik)

1. Asset-Allokation auf Basis von Trendfolge-Algorithmen (Rickenberg)

Marshall, B. R., Nguyen, N. H., & Visaltanachoti, N. (2016). Time series momentum and moving average trading rules. Quantitative Finance, S. 1-17

Faber, M. T. (2007). A Quantitative Approach to Tactical Asset Allocation. The Journal of Wealth Management, 9(4), 69.

Faber, M. (2017). A Quantitative Approach to Tactical Asset Allocation Revisited 10 Years Later. The Journal of Portfolio Management, 44(2), 156-167.

2. Wertsicherungsstrategien für Aktienportfolios (Bauer)

Basisliteratur:

Albrecht, P., Maurer, R. (2016). Investment- und Risikomanagement, 4. Auflage, Abschnitt 11.7.

Pain, D. (2008): Recent developments in portfolio insurance, Bank of England Quarterly Bulletin, 1, S. 37-46.