Themen Bachelor-Abschlussarbeiten im FSS 2020

(Betriebswirtschaftslehre)

1. **Investments in Kryptowährungen: Grundlagen und empirische Analysen (Bauer)**

   Albrecht, P., Huggenberger, M. (2015): Finanzrisikomanagement, 1. Auflage, Abschnitte 2 und 3.

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

   Böhme, R. et al. (2015). Bitcoin: Economics, Technology, and Governance. Journal of Economic Perspectives, 29,2, S. 213-238.

   Brière, M., Oosterlinck, K., & Szafarz, A. (2015). Virtual currency, tangible return: Portfolio diversification with bitcoin. Journal of Asset Management, 16 (6), 365–373.

2. **Investments in Hedgefonds: Grundlagen und empirische Analysen (Bauer)**

   Albrecht, P., Huggenberger, M. (2015): Finanzrisikomanagement, 1. Aufl., Abschnitte 2 und 3.

   Albrecht, P., Maurer, R. (2016): Investment- und Risikomanagement, 4. Aufl., Abschnitt 14.2.

   Hull, J. C. (2012): Risk management and financial institutions, third edition, Kapitel 4.

3. **Wertsicherungsstrategien für Aktienportfolios (Bauer)**

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

   Hull, J. C. (2015): Optionen, Futures und andere Derivate, 9. aktual. Aufl., Abschnitt 19.13.

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

4. **Aktienzertifikate: Grundlagen, Einsatzmöglichkeiten und Risikoanalyse (Bauer)**

   Albrecht, P., Maurer, R. (2016). Investment- und Risikomanagement, 4. Auflage, Abschnitt 14.5.

   Hull, J. C. (2015): Optionen, Futures und andere Derivate, 9. aktualisierte Auflage.

   Rudolph, B.; Schäfer, K. (2010). Derivative Finanzmarktinstrumente, 2. Auflage.

   https://www.gs.de/media/de/dokumente/service/newsletter/kompass/17-12_08_ZertiKompass.pdf

5. **Low Volatility Portfolios (Rickenberg)**

   Blitz, D., & Van Vliet, P. (2007). The volatility effect: Lower risk without lower return.

   Soe, A. M. (2012). Low-volatility portfolio construction: ranking versus optimization. The Journal of Index Investing, 3(3), 63-73.

Chow, T. M., Hsu, J. C., Kuo, L. L., & Li, F. (2014). A study of low-volatility portfolio construction methods. Journal of Portfolio Management, 40(4), 89-105.

6. Risk-Managed Momentum Strategien (Rickenberg)

Barroso, P., & Santa-Clara, P. (2015). Momentum has its moments. Journal of Financial Economics, 116(1), 111-120.

Grobys, K., Ruotsalainen, J., & Äijö, J. (2018). Risk-managed industry momentum and momentum crashes. Quantitative Finance, 18(10), 1715-1733.

Du Plessis, J., & Hallerbach, W. G. (2016). Volatility weighting applied to momentum strategies. The Journal of Alternative Investments, 19(3), 40-58.

7. Volatilitätsprognosen und Volatilitätsstrategien (Rickenberg)

Albrecht, P., Huggenberger, M. (2015): Finanzrisikomanagement, 1. Auflage, Abschnitte 3.3 und 3.4.3

Benson, R., Furbush, T., & Goolgasian, C. (2014). Targeting Volatility: A tail risk solution when investors behave badly. The Journal of Index Investing, 4(4), 88-101.

Harvey, C. R., Hoyle, E., Korgaonkar, R., Rattray, S., Sargaison, M., & Van Hemert, O. (2018). The Impact of Volatility Targeting. The Journal of Portfolio Management, 45(1), 14-33.

8. Dynamische Value at Risk-Prognosen (Rickenberg)

Albrecht, P., M. Huggenberger (2015): Finanzrisikomanagement, 1. Aufl., Stuttgart, Abschnitte 2.3, 2.4.1, 2.4.5, 2.8 und 3.3

Christoffersen, P. F. (2012): Elements of financial risk management, 2. Aufl; Kapitel 1 und 2 sowie Abschnitt 4.2

Morgan, J. P. (1996). RiskMetrics. Technical Report, S. 73-82.

9. Industrie und Style Momentum (Rickenberg)

Gupta, K., Locke, S., & Scrimgeour, F. (2010). International comparison of returns from conventional, industrial and 52-week high momentum strategies. Journal of International Financial Markets, Institutions and Money, 20(4), 423-435.

Swinkels, L. (2002). International industry momentum. Journal of Asset Management, 3(2), 124-141.

Novy-Marx, R. (2012). Is momentum really momentum?. Journal of Financial Economics, 103(3), 429-453, Abschnitt 5.

Lewellen, J. (2002). Momentum and autocorrelation in stock returns. The Review of Financial Studies, 15(2), 533-564.

Moskowitz, T. J., & Grinblatt, M. (1999). Do industries explain momentum?. The Journal of finance, 54(4), 1249-1290.