

## **Ankündigung**

### **Seminar im Bachelor Wirtschaftsmathematik, 5. Semester: Ausgewählte Themen aus der Finanzmathematik und Stochastik**

Leistungsnachweis durch Ausarbeitung einer Belegarbeit und eines Vortrages. Die Themen werden in Gruppen zu zweit bearbeitet.

1. Schätzung der Kovarianzmatrix von Renditen  
Kleberg/Rehkugler: Handbuch Portfolio-Management, Uhlenbruch Verlag, insbesondere Kapitel V, Artikel 1 und 2.
2. Stylized Facts von Finanzmarktrenditen  
E. Ratliff-Crain, C. M. Van Oort, J. Bagrow, M. T. K. Koehler and B. F. Tivnan:  
Revisiting Stylized Facts for Modern Stock Markets, in IEEE International Conference on Big Data, 2023
3. Anomalien am Aktienmarkt: Size- und Value-Effekt  
Hillebrand, D.: Der Size-Effekt - Beständige Anomalie am Aktienmarkt oder vorübergehendes Phänomen?, WiSt, S. 46-50, 2017
4. Anomalien am Aktienmarkt: Der Low-Vol-Effekt  
Blitz, D., van Vliet, P., Baltussen, G., & Baltussen, G.: The Volatility Effect Revisited, in: The Journal of Portfolio Management, Quantitative Special Issue, 2020
5. Replikation von Aktienindizes in ETFs: Theorie, Methodik, Empirie  
Tomasz Miziołek, Ewa Feder-Sempach, Adam Zaremba: International Equity Exchange-Traded Funds - Navigating Global ETF Market Opportunities and Risks, Springer, 2020
6. Hauptkomponentenanalyse am Beispiel der Zinsstrukturkurve deutscher Staatsanleihen  
Andreas Handl: Multivariate Analysemethoden, Springer, Kapitel 5.
7. Fallstudie: Induktive Statistik  
Lothar Sachs, Jürgen Hedderich: Angewandte Statistik - Methodensammlung mit R, Springer, Kapitel 5 und 6
8. Fallstudie: Regressionsanalyse am Beispiel des Münchener Mietmarktes  
Fahrmeir, Kneib, Lang: Regression, Springer

Einzelheiten zu den Themen und weitere Literatur werden zu Beginn des Semesters in Moodle zur Verfügung gestellt und bei der Auftaktveranstaltung des Seminars erläutert.