



Von Svend Reuse

Korrelationen in Extremsituationen

Eine empirische Analyse des deutschen Finanzmarktes mit Fokus auf irrationales Marktverhalten

2011. Mit einem Geleitwort von doc. Ing. Martin Svoboda, Ph.D. und Prof. Dr. Eric Frère

XXIII, 283 Seiten. Mit 76 Abb. u. 37 Tab.

Broschur. EUR 59,95

ISBN 978-3-8349-2724-8

Gerade vor dem Hintergrund der Finanzmarktkrise in 2008 sind die klassische Portfoliotheorie und die Wirkungsweise von Korrelationen erneut in die Kritik geraten. Svend Reuse analysiert das Verhalten von Korrelationen in Extremsituationen unter Berücksichtigung des irrationalen Marktverhaltens. Auf der Basis der Ergebnisse einer empirischen Umfrage bei 1.000 deutschen Kreditinstituten zum Verhalten von Korrelationen in der Praxis und dem Umgang mit Asset-Allocation evaluiert der Autor marktdatenbasierte Irrationalitätsindizes. Mit deren Hilfe entwickelt er ein eigenes Modell zur taktischen Outperformance des klassischen Markowitz-Ansatzes. Abschließend stellt er ein modifiziertes Optionspreismodell zur Absicherung von Korrelationsrisiken vor.

Inhalt

Bestandsaufnahme der Portfoliotheorie und der Asset-Allocation; Das Verhalten von Korrelationen in irrationalen Marktphasen; Modellierung von Korrelationen in irrationalen Extremsituationen; Entwicklung eines Korrelationszertifikates zur Portfolioabsicherung

Autor

Dr. Svend Reuse promovierte berufsbegleitend bei doc. Ing. Martin Svoboda, Ph.D. an der Masaryk Universität Brünn. Er ist Leiter der Abteilung Controlling eines Finanzinstituts und Dozent an der FOM Hochschule für Oekonomie und Management.

Ja, ich bestelle

Exemplare
Reuse, Svend
**Korrelationen in
Extremsituationen**
978-3-8349-2724-8
EUR 59,95

Erhältlich im Buchhandel oder beim Verlag. Innerhalb Deutschlands liefern wir versandkostenfrei. Änderungen vorbehalten. Stand 11 | 10

Gabler Verlag
Springer Fachmedien Wiesbaden GmbH
Abraham-Lincoln-Straße 46
65189 Wiesbaden, Germany
Geschäftsführer:
Dr. Ralf Birkelbach (Vors.), Armin Gross,
Albrecht F. Schirmacher
AG Wiesbaden HRB 9754

Fax +49(0)611. 7878 - 420

Firmenadresse Privatadresse

Name Vorname
Firma Uni
Abteilung Position
Branche Anzahl der Mitarbeiter im Unternehmen
Straße (bitte kein Postfach)
PLZ Ort
Datum Unterschrift

226 10 100

Bitte senden Sie mir den kostenlosen Gabler Gesamtkatalog 2009 | 2010

