

Themenbogen für Masterarbeiten (WS 2020/21)

Name: _____

Studiengang: _____

Themenwunsch (Bitte drei Wünsche mit Priorität von 1 bis 3 angeben):

<p>Strukturierte Finanzprodukte. Mögliche Themen befassen sich mit der Preisstellung der Anbieter von strukturierten Finanzprodukten im Zusammenspiel mit dem Kaufverhalten von privaten Anlegern. Ein Themenschwerpunkt liegt auf dem Intraday-Handel, insbesondere hinsichtlich spekulativer Produkte. Neben Bewertungsfragen können ferner auch regulatorische Maßnahmen in diesem Bereich analysiert werden.</p>	
<p>Optionen, Volatilitäten und Aktienkurse. In diesem Themenfeld können Optionsbewertungsverfahren wie etwa die Monte-Carlo-Simulation betrachtet werden. Ein weiterer Schwerpunkt liegt auf der Analyse von Preisschwankungen auf Finanz- und Energiemärkten, beispielsweise hinsichtlich des Risikos von Kurssprüngen. Hierzu können auch implizite Informationen aus Optionspreisen herangezogen werden, etwa im Zusammenhang mit dem „Volatility Smile“.</p>	
<p>Assetmanagement. Dieses Themenfeld beschäftigt sich mit Fragestellungen der Vermögensanlage, etwa hinsichtlich der optimalen Zusammenstellung von Portfolios in statischen und dynamischen Zusammenhängen. Ferner sind Maßnahmen der Absicherung von Risiken der Vermögensanlage relevant. Weitere Themen umfassen die Analyse von Handelsstrategien im Hinblick auf langfristige Profitabilität.</p>	
<p>Strom- und Energiemärkte. Abschlussarbeiten in diesem Themenfeld beschäftigen sich mit Akteuren und gehandelten Produkten auf Strombörsen wie der EPEX oder EEX, mit der Organisation des Marktes und Problemen des Marktausgleichs. Weitere Themen befassen sich mit der modellmäßigen Beschreibung der Preisentwicklung und der empirische Testung von Modellen, ferner mit derivativen Produkten auf diesen Märkten.</p>	
<p>Kapitalmarkttheorie und Asset Pricing. Ein wichtiger Zweig der Kapitalmarktforschung beschäftigt sich mit der Frage, welche Arten von Risiko am Markt vergütet werden. Auf dieser Basis kann auch eine Messung und Beurteilung der Leistung von Fondsmanagern erfolgen. Auch Abschlussarbeiten zur Bepreisung von Finanzinstrumenten wie Anleihen und Optionen können diesem Themenfeld zugeordnet werden.</p>	
<p>Markt- und Zinsrisiko. Dieses Themenfeld beschäftigt sich mit der Messung und Analyse des Markt- und Zinsrisikos anhand von Risikomaßen wie Value-at-Risk oder Expected Shortfall sowie mit dem Hedging dieser Risiken mit Forwards, Futures und Optionen. Des Weiteren können Veränderungen von Marktrisikoparametern wie der Zinsstruktur im Zeitablauf analysiert werden.</p>	
<p>Kreditrisiko. Ein Schwerpunkt dieses Themenfelds sind Credit Spreads von Anleihen verschiedener Seniorität im Zusammenhang mit externen Ratings. Des Weiteren steht Kreditrisiko bei der Analyse von strukturierten Finanzprodukten im Fokus. Ein spezifische Produktgruppe stellen die Bonitätsanleihen dar. Ferner können auch Fragen des Kreditrisikos im Zusammenhang mit Ansätzen zur Gesamtbanksteuerung adressiert werden.</p>	
<p>Green Finance. In diesem Themenfeld stehen nachhaltige und ökologische Investments im Fokus. Hierzu zählen beispielsweise die Analyse von Green Bonds sowie die Performance nachhaltiger Investmentfonds. Des Weiteren können Kapitalmarktmodelle betrachtet werden, die Nachhaltigkeitsaspekte explizit neben den klassischen Aspekten Rendite und Risiko modellieren.</p>	

Falls Sie innerhalb eines Themenfelds konkrete Vorstellungen haben (z. B. Spezifizierung der inhaltlichen oder methodischen Ausrichtung), sollten Sie dies im folgenden Bemerkungsfeld angeben.

Bemerkungen; Eigener Themenvorschlag mit Erläuterung:

Besondere Kenntnisse in Statistik, Tabellenkalkulation, empirischem Arbeiten etc.:

Veröffentlichung von Name und Thema

Der Lehrstuhl veröffentlicht auf seiner Homepage sowie in seinen Tätigkeitsberichten eine Liste von Abschlussarbeiten. Wir würden uns freuen, wenn Sie mit einer Erwähnung Ihres Namens einverstanden wären. Neben Name und Thema werden keine weiteren Informationen veröffentlicht.

- Ich bin mit der Nennung meines Namens im genannten Zusammenhang einverstanden.
Diese Einverständniserklärung kann jederzeit formlos widerrufen werden.
- Ich bin mit der Nennung meines Namens nicht einverstanden.