

Studie - Gering korrelierte Anlageklassen - Diversifikationsmodell der Vergangenheit?

Themenschwerpunkte

- ◆ Risiko-Management
- ◆ Korrelation in Krisen
- ◆ Vermögensverwaltung

Das Projekt wird in Kooperation zwischen dem Bayerischen Finanz Zentrum, der FidesTrust Vermögenstreuhand GmbH, München, Wegelin & Co. Privatbankiers, St. Gallen/Schweiz, und dem Center for Quantitative Risk Analysis an der Ludwig-Maximilians-Universität (LMU) München unter Leitung von Herrn Prof. Stefan Mittnik, Ph.D., durchgeführt.

Kontaktpersonen

Dr. Felix Breuer, Bayerisches Finanz Zentrum
Prof. Stefan Mittnik, Ph.D., Ludwig-Maximilians-Universität München

Partner des Bayerischen Finanz Zentrums



Studie - Gering korrelierte Anlageklassen - Diversifikationsmodell der Vergangenheit?

Beschreibung des Projekts

Im Rahmen einer Studie soll der Frage nachgegangen werden, ob die in der Verwaltung großer (privater) Vermögen bisher geübte Praxis einer Glättung von Marktrisiken durch Diversifikation in gering korrelierte Anlageklassen Gültigkeit hat und den von dem Anleger erhofften Nutzen erbringt.

Es soll u. a. untersucht werden, wie sich in Krisen die Korrelation historisch verändert hat, ob Korrelationen gerade in Krisen ansteigen, und ob diese Erkenntnisse zu Prognosezwecken genutzt werden können.

Die Studie soll interessierten Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt und in Fachzeitschriften veröffentlicht werden.