

Thema

Korrelationen im Risikomanagement – Fokus Zins, Aktien und weitere Faktoren

Abteilung: Betriebswirtschaft

Frage	Ziel
Welche statistischen Zusammenhänge bestehen zwischen Zins- und Aktienrenditen in unterschiedlichen Marktphasen?	Muster erkennen, die das Risiko-/Ertragsprofil verändern.
Wie wirken sich zusätzliche Faktoren (Rohstoffe, Währungen, Inflationsrate) auf die Gesamtkorrelation aus?	Vollständigeres Bild der Risikodynamik erhalten.
Inwiefern verändern sich die Korrelationen bei Stress- bzw. Krisenszenarien?	Risikomanagement-Strategien für Extremereignisse ableiten.

Erwartetes Ergebnis / Handlungsempfehlung:

- Analyse-Report mit quantitativen Kennzahlen (Korrelation, dynamische Korrelationen).
- Handlungsempfehlungen für Portfolio-Allokation (Diversifikation, Hedging-Strategien) und für die Anpassung von Risikoparametern (VaR, Stress-Testing).

Schwerpunkt: Praxisorientierte Anwendung auf das Risikomanagement – z. B. Optimierung von Zins- und Aktienportfolios im Hinblick auf stabile Risiko-Kennzahlen.

Umfang: Bachelor-/Masterthesis



Ansprechpartner:in

Michael Günther

 michael.guenther@sparkasse-wuppertal.de
 0202-4883541