

Universität Passau · 94030 Passau

Telefon	Prof. Dr. Wagner +49 (0)851 509-3240 +49 (0)851 509-3241
Telefax	+49 (0)851 509-3242
e-mail	nwagner@uni-passau.de Sekretariat: fincon@uni-passau.de
Zeichen	
Datum	01.09.2010

Themen können je nach Interessenlage laufend individuell mit den Mitarbeitern des Lehrstuhles vereinbart werden. Mögliche Themen und Themengebiete, die die Themenfindung erleichtern sollen, sind in folgender Liste zusammengestellt. Es können auch eigene Themenvorschläge (z.B. auf Basis einer besuchten Lehrveranstaltung oder eines Praxiskontaktes des Studierenden) gemacht werden.

Diplom/Master

Thema	Ansprechpartner
Welcher empirische Zusammenhang besteht zwischen Illiquidität und Rendite?	Elisabeth Winter
Illiquiditätsschocks im Zusammenhang mit Crashes am Kapitalmarkt: Eine empirische Untersuchung	Elisabeth Winter
Long-Run Performance of Pre- and Post-Peak IPOs around the NASDAQ Market Peak of 2000	Elisabeth Winter
Credit Default Swaps und Pfandbriefe unter Berücksichtigung von Kreditrisikomodellen	Bastian Breitenfellner
Preisbestimmung von Credit Default Swaps und Erklärungsansätze der Spreads	Bastian Breitenfellner
Modellierung von Abhängigkeitsstrukturen auf Kreditportfolioebene	Bastian Breitenfellner
Analyse des Zusammenhangs zwischen aggregierten Kreditrisiken und dem systemischen Risiko	Bastian Breitenfellner
Untersuchungen zu den Eigenschaften statistischer Modelle im Risikomanagement	Harald Kinateder

Quantifizierung des Marktrisikos anhand des RiskMetrics Ansatzes	Harald Kinateder
Zum Management zeitvariabler extremer Risiken auf Finanzmärkten – Modellierung und empirische Untersuchung	Harald Kinateder
Analyse der Kointegrationsbeziehungen des deutschen Kapitalmarktes	Harald Kinateder
Anwendungsmöglichkeiten der Extremwertstatistik zur Bestimmung von Marktrisikomaßen	Christoph Riedel
Effizientes Tail-Risikomanagement von Aktienportfolios	Christoph Riedel
Circuit Breakers und extreme Aktienmarktbewegungen	Christoph Riedel
Die Performance des DOW JONES EURO STOXX 50 Putwrite Index	Christoph Riedel
Benchmarks für den risikolosen Zins unter Einbeziehung von Fremdwährungsrisiken	Dr. Thomas Wenger
Cashflow mapping für implizite Optionen im klassischen Bankgeschäft	Dr. Thomas Wenger
Zentralbank-Aktionen und die Dynamik der shortrate: Abgleich zwischen Implikationen von makroökonomischen Modellen und Zinsstruktur-modellen	Dr. Thomas Wenger
Optionstheoretische Ansätze zur Bepreisung von covenants	Dr. Thomas Wenger

Bachelor

Thema	Ansprechpartner
Indexzertifikate im Vergleich zu aktiv gemanagten Fonds: Ein Performancevergleich	Elisabeth Winter
Hedge Fonds-Performance: Eine kritische Betrachtung unter Berücksichtigung statistischer Aspekte	Elisabeth Winter
Verschiedene Verfahren der Bildung von Aktienindizes im Vergleich	Elisabeth Winter
Wie bewertet man ETF-Qualität? Kriterien für ein ETF-Rating.	Elisabeth Winter
Prinzipal-Agentenkonflikte innerhalb des Kreditrisikotransfers	Bastian Breitenfellner
Simulationsbasierte Ansätze zu Ermittlung des Kreditrisikos auf Einzelschuldner- und Portfolioebene	Bastian Breitenfellner
Kreditrisikomodelle und Ihre Anwendung bei der Bewertung von Kreditderivaten	Bastian Breitenfellner

Aktienrückkäufe in Deutschland – Ihre Anwendung und eine Analyse der Kurswirkungen	Harald Kinateder
Theorie und Empirie des Zinsänderungsrisikos	Harald Kinateder
Analyse der Kurswirkungen von Übernahmeangeboten	Harald Kinateder
Value-at-Risk Prognose von finanziellen Risiken - Analyse der Prognosegüte von alternativen VaR-Verfahren	Harald Kinateder
Vergleich von Modellen zur Schätzung des zukünftigen VaR	Christoph Riedel
Möglichkeiten zur Messung der Liquidität und Illiquidität von Aktienmärkten	Christoph Riedel
Die Aussagekraft des Variance Risk Premiums für Aktienmarktrenditen – Empirische Analyse des Prognosegehalts	Christoph Riedel
Empirische Verteilungseigenschaften von Hedge Fund Renditen – Eine Analyse risikoadjustierter Performancemaße	Christoph Riedel
Einfluss von Aspekten des Insolvenzrechts im internationalen Vergleich bei der Bewertung und Bilanzierung von Kreditderivaten	Dr. Thomas Wenger
Ökonomischer Eigenkapitalbedarf von Banken bei Fusionen oder Konsolidierung	Dr. Thomas Wenger