

Inhalt

I. Strategische Asset Allocation

Theorie und Empirie der Asset Allocation	3
<i>Bernd Rudolph</i>	
Modellgestützte Planung der Strategischen Asset Allocation: Von der Theorie zur Praxis	27
<i>Hubert Dichtl / Jochen M. Kleeberg / Christian Schlenger</i>	
Asset Allocation in Europa: Die Performance von Aktien und Renten nach den „Goldenen Neunzigern“	67
<i>Andreas Sauer</i>	
Schätzung von Risikoprämien in der Asset Allocation	91
<i>Klaus Reimer / Alexander Zanker</i>	
Langfristige Risikoprämien für die Strategische Asset Allocation mit dem Internationalen CAPM	113
<i>Thomas Ebertz / Andreas Schmidt-von Rhein / Norbert Tolksdorf</i>	
Bedeutung von Korrelationsstrukturen in der Strategischen Asset Allocation ...	157
<i>Youssef Affany / Gary Dugan / Dominique von Aufschnaiter</i>	

II. Dynamische und Taktische Asset Allocation

Dynamische Asset Allocation im Lichte der Präferenzen institutioneller Anleger	179
<i>Hubert Dichtl / Kerstin Petersmeier / Christian Schlenger</i>	
Einsatz des Black-Litterman-Verfahrens in der Asset Allocation	203
<i>Wolfgang Drobetz</i>	
Optimierung von Dynamischen Asset Allocation-Strategien	241
<i>Thomas Stephan</i>	
Forecasting European Equity and Bond Returns for Tactical Asset Allocation	267
<i>Stan Beckers / Bevan Blair</i>	
Trendfolgestrategien in der Asset Allocation	287
<i>Carsten Grosse-Knetter</i>	

III. Spezialfragen der Asset Allocation

Resampling der Effizienzlinie	319
<i>Bernhard Scherer</i>	
Risk Based Asset Rebalancing	337
<i>Ronald G. Layard-Liesching</i>	
Integrierte Parameterschätzung für die Asset Allocation	361
<i>Kerstin Petersmeier / Thorsten Poddig</i>	
Asset Allocation und Anlagehorizont	389
<i>Thomas Albrecht</i>	
Assetklassenübergreifende Risikomessung	415
<i>Carl-Heinrich Kehr</i>	
Cost-Averaging versus Buy-and-Hold	439
<i>Markus Walze / Alexis Eisenhofer / Alfred Wettach</i>	

IV. Praktische Umsetzung der Asset Allocation

Transaktionskosten und Best Execution im Aktienfondsmanagement	459
<i>Lutz Johanning / Jochen M. Kleeberg / Christian Schlenger</i>	
Characteristics of Equity Benchmark Indices as Tools in Asset Allocation	499
<i>Jacques Roulet</i>	
Mandatsstrukturierung nach dem Core-Satellite-Ansatz	529
<i>Karl Georg Bayer / Michael Fraikin / Martin Kolrep</i>	
Private Equity und Hedge Funds in der Strategischen Asset Allocation	571
<i>Andreas Grünbichler / Steffen Graf / Christian Wilde</i>	
Home Bias in der Asset Allocation	601
<i>Karsten Jeske</i>	
Asset Allocation für Privatanleger	623
<i>Claus Huber / Helmut Kaiser</i>	
Autorenverzeichnis	649
Stichwortverzeichnis	663