

Neue Forschungsprojekte – Forschungsförderer gesucht

Die Ausgangslage

Das DIPS Deutsches Institut für Portfolio-Strategien ist die finanzwirtschaftliche Forschungseinrichtung der FOM Hochschule für Oekonomie & Management in Essen.

Im Fokus der wissenschaftlichen Arbeit stehen insbesondere praxisrelevante Problemstellungen des Portfolio-Managements – Hauptforschungsfelder in diesem thematischen Kontext sind:

- Strategische Asset Allocation / Passives Portfoliomanagement
- Optimized Indexing / Quantitative Investment-Modelle
- Wechselbeziehungen zwischen Corporate Finance und Asset Management

Unsere Forschungsergebnisse kommunizieren wir einerseits über Studien und Fachartikel; andererseits veranstaltet das Institut auch öffentlich zugängliche Fachtagungen und Informationsveranstaltungen. Sofern möglich, werden Forschungsprojekte dergestalt strukturiert, dass auch durch daraus optional ableitbare Indices ein kontinuierlicher Erkenntniswert entsteht.

Unterstützt werden Forschung und Lehre durch den mit renommierten Wissenschaftlern, Finanzanalysten und Vermögensverwaltern besetzten Beirat sowie das akademische Netzwerk der FOM - einer der größten privaten Hochschulen in Deutschland.

Hinzu kommen globale oder projektbezogene Kooperationen mit Verbänden, Medien und anderen wissenschaftlichen Einrichtungen, etwa der Masaryk Universität (Brno / Tschechien) oder der DSW Deutsche Schutzvereinigung für Wertpapierbesitz e.V.

Ziele des neuen Forschungsprojektes

Zielsetzungen des Forschungsprojektes ist die Schaffung eines Beitrags zur Transparenzerhöhung im Finanz- und Kapitalmarkt, insbesondere von Finanzstrategien und –anlagen.

Es sollen u.a. systematische Untersuchungen von verschiedenen Asset-Klassen vorgenommen werden, wobei die Interessen sowohl von institutionellen als auch privaten Anlegern berücksichtigt werden. In das Forschungsprojekt sollen sowohl klassische als auch innovative Finanzprodukte einbezogen werden. Zugleich soll auf das diesbezügliche Management und auf die zugrundeliegenden Finanzstrategien eingegangen werden. Auf die bisherigen Forschungsergebnisse des dips wird systematisch zurück gegriffen, auch in Bezug auf die Möglichkeit, mit Hilfe eines Bloombergterminals real-time financial market data movements auszuwerten.

In dem Forschungsprojekt sollen mit Hilfe eines wissenschaftlichen Mitarbeiters folgende Fragestellungen in Unterprojekten untersucht werden:

- Analyse von Risiken von Anlegern in Unternehmens- und Hypothekenanleihen sowie Genussscheinen insbesondere im Hinblick auf systematische Risiken bei der Strukturierung.
- Analyse der Leistungsbilanz u.a. geschlossener Beteiligungen im Bereich regenerativer Energien bzw. sog. nachhaltiger Anlagen (Nachhaltigkeit der Produkte/ Kriterien).
- Erfolgsmessung von Merger & Akquisitions Deals im Mittelstand (Empirische Betrachtung, Übernahmewahrscheinlichkeitsmodelle)
- Vergleich der Corporate Governance -Systeme (Ranking)

Zeitraum des Forschungsprojektes

Ab Frühjahr 2012 für drei Jahre. Eine Verlängerung ist angestrebt.

Projektbeteiligung: Ihre möglichen Beiträge

Sie sind herzlich eingeladen, am neuen Forschungsprojekt direkt zu partizipieren.

Es gibt unterschiedliche Möglichkeiten, sich an dem Projekt zu beteiligen:

Sie können sich entweder mit Ihrem fachlichen Knowhow einbringen und geben uns aus Ihrer Praxisperspektive und Ihrem beruflichen Umfeld Feedback bei der Formulierung der Forschungshypothesen und zu den Forschungsergebnissen.

Alternativ können Sie sich finanziell in Form von Spenden an dem Forschungsprojekt beteiligen. Die Umsetzung des Forschungsprojektes soll mit Hilfe eines wissenschaftlichen Mitarbeiters stattfinden. Für diese anteilige Personalstelle brauchen wir Ihre finanzielle Unterstützung. Die Overheadkosten des Projektes werden vom DIPS getragen. Eine finanzielle Beteiligung sollte insoweit nachhaltig sein, als sie sich auf zunächst drei Jahre erstreckt. Eine Verlängerung des Projektes ist angestrebt.

Wie Sie von einer Beteiligung profitieren:

Sie erhalten regelmäßig einen aktuellen Stand zu internationalen Forschungsergebnissen im Themenfeld. Sie können selbstverständlich kostenlos an den Projektveranstaltungen (Vorträge, Workshops, etc.) teilnehmen.

Bei Publikationen wird auf Ihre finanzielle Unterstützung unseres Forschungsprojektes hingewiesen.

Kontaktdaten:

Bei Interesse an einer Beteiligung oder bei Fragen wenden Sie sich bitte an

Prof. Dr. Eric Frère

Direktor dips

mobil: +49 (0) 172 245 13 45

fax: +49 (0) 201 176 85 47

eric.frere@fom.de