

Peter Oertmann – Publication List

Books

1. Global Risk Premia on International Investments, Gabler, 1996
2. Global Asset Allocation: New Methods and Applications, John Wiley & Sons, 2003
(with Heinz Zimmermann and Wolfgang Drobetz)

Articles in scientific journals

3. Firm-Size-Effekt am deutschen Aktienmarkt, Zeitschrift für betriebswirtschaftliche Forschung, Vol. 46, 1994
4. Size und Performance von deutschen Aktien, Financial Markets and Portfolio Management, Vol. 8, 1994
5. Bestimmt die Wall Street das weltweite Börsengeschehen?, Financial Markets and Portfolio Management, Vol. 9, 1995
6. Über die psychologische Wirkung eines Indexstandes, Financial Markets and Portfolio Management, Vol. 10, 1996
7. U.S. Mutual Fund Characteristics Across the Investment Spectrum, The Journal of Investing, Vol. 5, 1996 (with Heinz Zimmermann)
8. Corporate Governance - Schweizer Erfahrungen, Zeitschrift für Betriebswirtschaft (ZFB), Sonderausgabe Governance Structures, 1996 (with Andreas Grünbichler)
9. Wieviel Noise erträgt ein Prognosemodell für die taktische Asset Allokation?, Financial Markets and Portfolio Management, Vol. 11, 1997 (with Heinz Zimmermann)
10. Why do value stocks earn higher returns than growth stocks, and vice versa?, Financial Markets and Portfolio Management, August 2000
11. Interest rate risk of European financial corporations, European Financial Management, December 2000 (with Christel Rendu and Heinz Zimmermann)

Contributions to textbooks

12. Lassen sich Aktienkurse prognostizieren?, in Gehrig, Bruno and Heinz Zimmermann (Hrsg.), Fit for Finance, Verlag NZZ, 1996
13. Capital Asset Pricing Model, in Gehrig, Bruno and Heinz Zimmermann (Hrsg.), Fit for Finance, Verlag NZZ, 1996
14. Investment Style, in Gehrig, Bruno and Heinz Zimmermann (Hrsg.), Fit for Finance, Verlag NZZ, 1996
15. Über die Kapitalkosten von Grossbanken bei integrierten Kapitalmärkten, in Geiger et al. (Hrsg.): Schweizerisches Bankwesen im Umbruch, Verlag Paul Haupt, 1996
(with Heinz Zimmermann)
16. Bestimmungsfaktoren der Aktienmarktentwicklung: Eine empirische Analyse für den Schweizer Aktienmarkt, in Schmid, Christian and Burkhard Varnholt (Hrsg.), Finanzplatz Schweiz, Verlag NZZ, 1997 (with Heinz Zimmermann)

17. Ein konditioniertes Multifaktorenmodell für das Management internationaler Aktienanlagen, in Kleeberg, Jochen and Heinz Rehkugler (Hrsg.), Handbuch Portfoliomanagement, Uhlenbruch Verlag, 1998
18. Risk and Return: Vom CAPM zur modernen Asset Pricing Theory, in Brunetti et al.: Economics Today, Verlag NZZ, 1998 (with Heinz Zimmermann)
19. Taktische Asset Allocation auf der Basis konditionierter Renditeerwartungen, in Kleeberg, Jochen and Heinz Rehkugler (Hrsg.), Handbuch Portfoliomanagement, Uhlenbruch Verlag, 2002 (with Wolfgang Drobetz)
20. Zyklische und antizyklische Handelsstrategien am Schweizer Aktienmarkt: Marktineffizienzen oder ökonomisch fundierte Gewinnpotenziale, in Leser, Hartmut and Markus Rudolf (Hrsg.), Handbuch Institutionelles Asset Management, Gabler Verlag, 2003 (with Ueli Mettler)
21. Der Einfluss von Hedge Funds auf das Risiko globaler Portfolios, in Kleeberg, Jochen (Hrsg.), Handbuch Hedge Funds, Uhlenbruch Verlag, 2005 (with Greg Sohn)
22. The Effect of Hedge Funds on the Risk Profile of Global Portfolios, in Gregoriou, G. and Dieter Kaiser (Hrsg.), Hedge Funds and Managed Futures, A Handbook for Institutional Investors, Riskbooks, 2006

Contributions to professional journals

23. Das Zinsänderungsrisiko bestimmt die Kapitalkosten, Schweizer Bank, 2, 1997 (with Heinz Zimmermann)
24. Neue Strategien zur Diversifikation, Schweizer Bank, 3, 1998 (with Heinz Zimmermann)
25. Global Economic Risk Profile, Schweizer Bank, 4, 1998 (with Heinz Zimmermann)
26. Absolute Returns mit taktischer Asset Allokation, Absolut Report, 2003
27. Risiken von Hedge Funds aus der Perspektive eines global diversifizierten Investors, Absolut Report, 2005 (with Greg Sohn)
28. Konditionierte Anlagestrategien in Rohstoff-Futures, Absolut Report, 2006 (with Viola Markert)
29. Neue Möglichkeiten für eine dynamische Asset Allocation, Absolut Report, 2010 (with Daniel Seiler)
30. 1/N für die Asset Allocation, Absolut Report, 2011 (with Daniel Seiler and Franziska Kirner)
31. Faktorbasierte Aktienstrategien im Konjunkturzyklus, Absolut Report, 2018

Selected articles in newspapers and in professional journals

32. Die optimale Grösse des Verwaltungsrats: Wie bewertet die Börse die Ausgestaltung des Führungsorgans?, Neue Zürcher Zeitung, Fokus der Wirtschaft, 8/9 June 1996 (with Andreas Grünbichler)
33. Wenn Wall Street hustet ... – Die Preisvolatilität von US-Aktien als globales Risiko, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 23 July 1996

34. Das Märchen der psychologischen Index-Barrieren, Finanzmarkt Schweiz, 8 January 1997
35. Zusammenwachsen der Märkte fordert internationales Asset Management heraus, Finanzmarkt Schweiz, 10 March 1997
36. Die Finanzmärkte tanzen zunehmend im Gleichschritt, Finanz und Wirtschaft, Podium, 12 November 1997 (with Heinz Zimmermann)
37. Kein Schutz, wenn er am nötigsten wäre ..., Finanz und Wirtschaft, 12 November 1997
38. Über die Konditionierung auf das Klima ..., Insider, Schweizerisches Institut für Banken und Finanzen, 1998
39. Statistische Methoden für die taktische Asset Allocation: Neue Modelle, Finanz und Wirtschaft, 26 August 1998
40. Neuer starker Trend zum aktiven Management..., Finanz und Wirtschaft, 26 August 1998
41. Die Risikoprämie als Teil der Renditeerwartung: Variierende Preise für die gehandelten Risiken, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 22 October 1998
42. Nicht eine Frage des Stils, sondern des Timings: Mit Value- und Growth-Zyklen richtig umgehen, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 7 August 2000
43. Vernachlässigte Kreditrisikoprämien, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 20 August 2002 (with Heinz Zimmermann)
44. Gehandelte Erwartungen, Hedge Funds Magazin, Nr. 3, 2003
45. Absolute Return statt Benchmark-Strategien, Börsen-Zeitung Nr. 45, 5 March 2004
46. Alpha verkauft sich, Private Wealth, Interview, April 2006
47. Wie Informationen mehr Rendite bringen, Euro am Sonntag, 14 Oktober 2007
48. Beta effektiver nutzen, Absolut Report, 2009
49. Standpunkte: Welche Strategie trifft die besseren Anlageentscheidungen?, spn, June/July 2009
50. Nehmen Sie sich Zeit für Ihr Beta, Absolut Report, 2013
51. Factor Investing: Alter Wein, aber ein tolles Cuveé, Absolut Report, 2017

Selected white papers

52. How to understand and harvest risk premia in capital markets, Vontobel Asset Management, February 2018
53. Factor-based equity strategies in the business cycle – some basic analyses, Vontobel Asset Management, November 2018

Status: December 2022