

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, Greg N. and Dieter G. 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
32. **KI-basierte Aktienselektion: Herausforderungen, Erfahrungen und Mehrwerte**, Absolut Report, 2024 (with Daniel Willmann)
33. **Informierte taktische Aktienquotensteuerung auf Basis von KI**, Absolut Report, Spezial, 2025 (with Andreas Fuest and Daniel Willmann)

Selected articles and interviews in newspapers and in professional journals

34. **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)
35. **Wenn Wall Street hustet ... – Die Preisvolatilität von US-Aktien als globales Risiko**, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 23 July 1996
36. **Das Märchen der psychologischen Index-Barrieren**, Finanzmarkt Schweiz, 8 January 1997
37. **Zusammenwachsen der Märkte fordert internationales Asset Management heraus**, Finanzmarkt Schweiz, 10 March 1997
38. **Die Finanzmärkte tanzen zunehmend im Gleichschritt**, Finanz und Wirtschaft, Podium, 12 November 1997 (with Heinz Zimmermann)
39. **Kein Schutz, wenn er am nötigsten wäre ...**, Finanz und Wirtschaft, 12 November 1997
40. **Über die Konditionierung auf das Klima ...**, Insider, Schweizerisches Institut für Banken und Finanzen, 1998
41. **Statistische Methoden für die taktische Asset Allocation: Neue Modelle**, Finanz und Wirtschaft, 26 August 1998
42. **Neuer starker Trend zum aktiven Management...**, Finanz und Wirtschaft, 26 August 1998
43. **Die Risikoprämie als Teil der Renditeerwartung: Variierende Preise für die gehandelten Risiken**, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 22 October 1998
44. **Nicht eine Frage des Stils, sondern des Timings: Mit Value- und Growth-Zyklen richtig umgehen**, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 7 August 2000
45. **Vernachlässigte Kreditrisikoprämien**, Neue Zürcher Zeitung, Börsen und Märkte, 20 August 2002 (with Heinz Zimmermann)
46. **Gehandelte Erwartungen**, Hedge Funds Magazin, Nr. 3, 2003

47. [Absolute Return statt Benchmark-Strategien](#), Börsen-Zeitung Nr. 45, 5 March 2004
48. [Alpha verkauft sich](#), Private Wealth, Interview, April 2006
49. [Wie Informationen mehr Rendite bringen](#), Euro am Sonntag, 14 Oktober 2007
50. [Beta effektiver nutzen](#), Absolut Report, 2009
51. [Standpunkte: Welche Strategie trifft die besseren Anlageentscheidungen?](#), spn, June/July 2009
52. [Nehmen Sie sich Zeit für Ihr Beta](#), Absolut Report, 2013
53. [Factor Investing: Alter Wein, aber ein tolles Cuveé](#), Absolut Report, 2017
54. [GPT-Chatbots werden mehr Fachwissen in die Portfolios bringen](#), Absolut Report, 2023
55. [Künstliche Intelligenz produziert Rendite](#), Interview, dpn, Februar, März 2025
56. [Wie Künstliche Intelligenz die Fondsbranche verändert](#), Gastbeitrag, Frankfurter Allgemeine Zeitung, 28 October 2025

Selected white papers

57. [How to understand and harvest risk premia in capital markets](#), Vontobel Asset Management, February 2018
58. [Factor-based equity strategies in the business cycle – some basic analyses](#), Vontobel Asset Management, November 2018

Status: January 2026