

## Quantitative Trading Competition – Trading Financial Anomalies in the Market

*Hinweis: Arbeiten können sowohl in Deutsch als auch in Englisch verfasst werden*

Anomalien am Aktienmarkt bezeichnen Renditeunterschiede zwischen spezifisch ausgewählten Aktien, die anhand eines theoretischen Asset Pricing Modells nicht vollständig erklärt werden können. Sie werden oftmals als Ausgangspunkt für konkrete Handelsstrategien von Marktteilnehmer genutzt. Ziel des Seminars ist es, dass die Teilnehmer eine Anomalie auswählen, eine passende Handelsstrategie entwickeln und diese Strategie in einer simulierten Handelsumgebung praktisch umsetzen, indem sie die tatsächlichen Trades ausführen. Abschließend soll die Performance der Handelsstrategie insbesondere unter Berücksichtigung der angefallenen Trading Fees evaluiert werden und der Bestand der Anomalie im Markt diskutiert werden.

Weitere Details gibt es in Kürze auf unserer Homepage und im Wiwi-Portal.

### Termine:

- Bewerbungsfristen: 02.02.2024 (erste Vergaberunde) / 15.03.2024 (zweite Vergaberunde)
- Blockseminar: 11./12.07.2024