

[K18-V03] Kennzahlen - Performance, Renditeeffekte und Risiko

Seminarinhalte

Im Rahmen des Seminars werden die Anforderungen für die Renditenberechnung und -beschreibung erklärt und die Auswirkungen auf Anleger und Kundenberater durchleuchtet. Der Lehrgang vertieft das Verständnis für Renditen mit und ohne die Einbeziehung von Benchmarks. Er erklärt diverse Methoden und deren Darstellung in Berichten anhand von Beispielen. Für eine Beschreibung und Analyse von Renditen werden Risikokennzahlen einbezogen. Der Kurs rundet seinen Inhalt mit diversen Rendite-Risiko-Kennzahlen ab.

Einführung in die Renditebetrachtung

- Rendite im Allgemeinen
- Begriffe, Kennzahlen
- Beispiele

Gesetzliche Regelungen

- MiFID
- GIPS/BVI

Absolute Rendite

- Berechnungsmethoden:
TWR / MWR / TTWR
- Verkettung

Renditeeffekte

- Kapitaleffekt
- Währungseffekt
- Einkommenseffekt
- Crosseffekte

Marktstandards

- Behandlung von Gebühren, Steuern im Rahmen der Renditeberechnungen und deren Einfluss auf Netto- und Bruttorenditen

Benchmarks

- Aktienindex
- FI-Index
- besondere Indizes

Relative Rendite

- Brinson-Fachler
- IBPA (fixed Income)

Risikokennzahlen

- Risikokennzahlen und deren Erläuterung für:
 - Tracking Error
 - Sharpe
 - Jensen alpha
 - Beta
 - Treynor
 - Information ratio
 - Value at Risk
 - Bestimmtheitsmaß
- Beispiele

THEORIE

Zielgruppe

- Mitarbeiter im Portfoliomanagement
- Mitarbeiter im Fondscontrolling
- Mitarbeiter im Projektumfeld d. Fondsmanagements
- Anleger in Spezial-AIFs

Vorkenntnisse:

Kenntnisse Investmentfonds, Finanzmathematik

Seminararten:

Dauer: 1 Tag
Preis: EUR 1.195 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 8

Termine:

27. September 2018