

[K19-G05] 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 Rendite

- Rendite im Allgemeinen
- Begriffe, Kennzahlen
- Beispiele

Gesetzliche Regelungen/Marktstandard

Absolute Rendite

- MWR
- TWR
- Verkettung

Renditeeffekte

- Kapitaleffekt
- Währungseffekt
- Einkommenseffekt

Benchmarks

- Aktienindex
- FI-Index
- besondere Indizes

Relative Rendite

- Brinson-Fachler

Risikokennzahlen

- Sharpe
- Jensen alpha
- Beta
- Treynor
- Information ratio
- Value at Risk
- Bestimmtheitsmaß

THEORIE

- ▶▶ Das Seminar 'K19-G05 | Kennzahlen - Performance, Renditeeffekte & Risiko' ist Bestandteil des Seminars 'K19-G06 | Workshop: Kennzahlen - Performance, Renditeeffekte & Risiko' und kann separat gebucht werden.

Zielgruppe

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

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse Investmentfonds, Finanzmathematik

Seminararten: Dauer: 1 Tag
Preis: EUR 1.250 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 8

Termine: 14. Oktober 2019