

Behavioural Finance, Faktor Investing & Smart Beta

Wie Psychologie Investoren und Preise beeinflusst

Die neuere Wirtschaftswissenschaft hat gezeigt, was Praktiker schon lange behaupten: Märkte sind nur zum Teil rational. Ein Muss für all jene, die an aktuellen Themen in der Vermögensverwaltung interessiert sind.

Investoren neigen zu systematischen Fehleinschätzungen und Informationen werden vom Markt verspätet oder falsch interpretiert. Der erste Teil dieses Kurses widmet sich ganz der Verhaltensökonomie, dem Studium menschlichen Verhaltens in wirtschaftlichen Situationen. Wir erklären die verhaltenspsychologischen Phänomene und schärfen das Bewusstsein, um Veranlagungen, Fallstricke und Muster zu erkennen.

Im zweiten Teil des Kurses untersuchen wir, wie das Investorenverhalten die Marktpreise beeinflusst. Wir beschreiben die Renditetreiber, die sich als Konsequenz psychologischer und struktureller Verhaltensmuster im Markt etablieren und zeigen, wie systematische «quantitative» Investitionsstrategien davon profitieren. Viele Diskussionen im Asset Management drehen sich heutzutage um systematische Strategien wie Smart Beta, Faktorallokation und Faktorinvesting. Dieser Kurs erklärt diese Strategien und deren Grundlagen.



Aktuelle
Finanzthemen

Regulation &
Compliance

Anlagen, Märkte
& Produkte

Finanzieren &
Vorsorgen

Lernziele

- Welche kognitiven und emotionalen Faktoren beeinflussen und trüben unser Urteilsvermögen?
- Von Verhaltenspsychologie profitieren, ohne sich in ihren Fallstricken zu verfangen
- Systematischen Preistreiber im Markt: Momentum, Value, Size, Carry, etc
- Risiko- und Renditetreiber: traditionelles Beta, alternatives Beta und Alpha
- Systematische Investitionsstrategien: Smart Beta, Faktorallokation und Faktorinvesting

Themenblöcke

- Effiziente Märkte und «Behavioural Finance» – Beispiele irrationaler Märkte
- Entscheidungen unter Unsicherheit – Fallstudien
- Der fehlbare Investor – eine Katalogisierung
- Risiko- und Renditetreiber – traditionelles Beta, alternatives Beta und Alpha
- Die klassischen Renditefaktoren und warum sie existieren
- Wie investiere ich in «Faktor», die Konstruktion von Faktorportfolios
- Smart Beta, Faktor Indizes und systematische Strategien

Dauer

Präsenztraining 1 Tag (8 Stunden)

Zielgruppe

Kundenberater, Produktspezialisten, Asset Managers, institutionelle Anleger, Pensionskassen

SAQ-Zertifizierung «Kundenberater Bank»

Dieser Kurs steht allen interessierten Personen offen. Das Präsenztraining ist von SAQ als Re-Zertifizierungsmassnahme im Zertifizierungssystem «Kundenberater Bank» anerkannt. Es wird als Teilmassnahme im Umfang von 8 Stunden für folgende Zertifizierungen angerechnet:

- Certified Wealth Management Advisor CWMA
- Certified Corporate Banker CCoB

Weitere anrechenbare Re-Zertifizierungsmassnahmen finden Sie auf unserer Webseite.

«Qualified independent wealth manager VSV»

Ausgewählte Kurse sind im Rahmen des Weiterbildungsprogramms «Qualified independent wealth manager VSV» des Verbands Schweizerischer Vermögensverwalter (VSV) anerkannt. Sie können die Kurse direkt auf der Webseite www.vsv-asg-training.ch buchen und erhalten vom VSV Kreditpunkte angerechnet.

Kursdaten & Registration

Registrieren Sie sich online für den gewünschten Kurs.

Ihr Ansprechpartner für Ausbildungsfragen rund um das Thema Börse und Finanzmärkte:

www.six-swiss-exchange.com/education


Ausbildungspartner:

SIX
Securities & Exchanges
Pfungstweidstrasse 110
Postfach
8021 Zürich

T + 41 58 399 3099
education@six-group.com
www.six-group.com/exchanges

NoscoPartners ■■■
Financial Market Education

 **saq**
Personnel
Certification
Swiss Association for Quality

 **VSV
ASG**
Verband Schweizerischer Vermögensverwalter | VSV
Association Suisse des Gérants de Fortune | ASG
Associazione Svizzera di Gestori di Patrimoni | ASG
Swiss Association of Asset Managers | SAAM