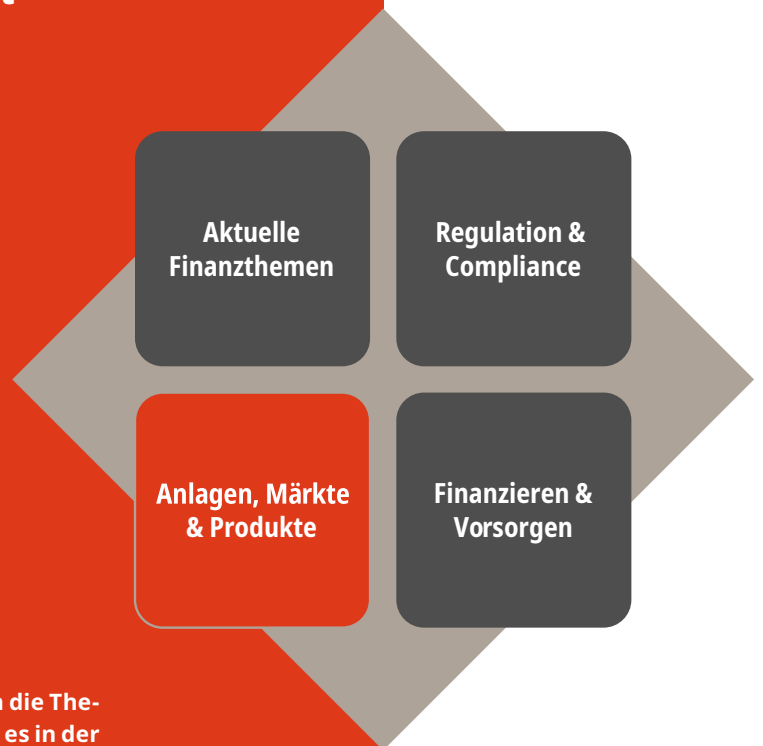


Portfolio Konstruktion & Analyse

**Bau, Analyse und Management
effektiver Portfolios**



Dieser Kurs bietet einen detaillierten Einblick in die Theorie des Portfoliomanagements und erklärt wie es in der Praxis angewendet wird.

Ein gutes Portfolio hält Risiken und erwartete Renditen im Gleichgewicht. Auf diesem Grundgedanken ruht ein Grossteil der heutigen Vermögensverwaltung. Wir vergleichen Risiken und Renditen verschiedener Beispiel-Portfolios, gebrauchen unsere Einsichten um effiziente Portfolios zu charakterisieren um daraus schliesslich ökonomische Schlüsse zu ziehen. Die Teilnehmer lernen dabei die fundamentalen Konzepte und Masse der Vermögensverwaltung kennen und anzuwenden: CAPM, Alpha, Beta, Sharpe Ratio, Information Ratio, etc. Es ist das Ziel dieses Kurses den Teilnehmern einerseits die Grundlagen effizienter Portfoliokonstruktion zu erklären und andererseits aufzuzeigen wie Portfolios in der Praxis analysiert und gepflegt werden.

Lernziele

- Risiko und Diversifikation – Verstehen, messen und nutzen
- Markowitz, Sharpe & CAPM: Die fundamentalen Konzepte der Portfoliokonstruktion
- Der Weg vom Risikoprofil zur Anlagelösung
- Absolutes und relatives Portfoliomanagement: Benchmarks, Alpha und Beta
- Die Grenzen traditioneller Portfoliokonstruktion und alternative Ansätze
- Wie liest und interpretiert man einen Portfolioreport?

Themenblöcke

- Rendite & Risiko – Masse und Charakteristiken
- Ein Blick in die Werkzeugkiste – Was der Vermögensverwalter über Statistik wissen muss
- Effiziente Portfolios – Die Eckpfeiler der modernen Portfoliotheorie
- Minimum Varianz, Maximum Sharpe Ratio und die Effizienzkurve
- Kapitalmarktmodell (CAPM) – Die Geburt von Alpha & Beta
- Benchmarks und aktives Portfoliomanagement
- Portfoliokonstruktion in Theorie und Praxis
- Alternativen zu Markowitz – Risikoparität, maximale Diversifikation und Weiteres

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:

- Zertifizierter Affluent Kundenberater
- Certified Wealth Management Advisor CWMA
- Certified Corporate Banker CCoB

Weitere anrechenbare Re-Zertifizierungsmassnahmen finden Sie auf unserer Webseite.

Ausbildungspartner

Nosco Partners AG

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: