

Portfolio-Management

Ziele und Nutzen

Auf Basis der Portfoliotheorie lernen Sie, das Verhältnis von Rendite und Risiko Ihres Portfolios mittels statistischer Analyseverfahren zu optimieren und können dementsprechend Ihre Investmententscheidungen treffen. Wesentliche Kennzahlen wie Betafaktor, Korrelation und Kovarianz werden im Detail vorgestellt und unterstützen das Grundverständnis für diesen Investmentansatz. Dieses Seminar eignet sich ideal als Vorbereitung für das aufbauende Modul „Angewandte Asset Allocation“ (S. 30).

Inhalt

- Renditen
 - Einfache Rendite
 - Geometrische Durchschnittsrendite
 - Geldgewichtung
 - Yield-To-Maturity (YTM)
 - Stetige Renditen
 - Continuous Compounding
- Überlegungen zu effizienter Diversifikation
- Berechnung verschiedener Kennzahlen
 - Volatilität
 - Downside Risiko
 - Beta
 - Korrelation
- Minimum-Varianz-Modell
- Zielfunktion und Indifferenzkurve
- Rechenbeispiele

Trainer



Mag. Werner Obenaus, CIIA, CFP

Wealth Advisor,
Bank Austria Private Banking

Seminarbeitrag

EUR 435 inkl. Unterlagen,
Pausen- und Mittagsverpflegung
und Parkmöglichkeit

Anrechenbar für

Certified Financial Planner
Diplom. Finanzberater/-innen

Empfohlene Vorkenntnisse

Das 1x1 der Wertpapiere (S. 8)
Aktien (S. 14)

Hinweis

Bitte nehmen Sie einen
Taschenrechner mit.

Seminarpaket

Dieses Seminar ist auch als
Paket buchbar (S. 42).

Termine und Anmeldung

www.wifiwien.at/39395x

