

# 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](http://www.wifiwien.at/39395x)

