

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 entsprechend 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. 20).

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 Planner,
Bank Austria Wealth Management

Seminarbeitrag

EUR 190 inkl. Unterlagen,
Pausenverpflegung und
Parkmöglichkeit

Anrechenbar für

Certified Financial Planner,
Diplom. FinanzberaterInnen,
European Financial Practitioner
NEU: MiFID II

Empfohlene Vorkenntnisse

Das 1x1 der Wertpapiere (S. 6),
Aktien (S. 10)

Hinweis

Bitte nehmen Sie einen
Taschenrechner mit.

Seminarpaket

Kombinieren Sie dieses Seminar
mit dem Seminar Angewandte
Asset Allocation (S. 20) zum
Vorteilspreis von EUR 320.

Termine und Anmeldung

www.wifiwien.at/39395x

