

[FKN] Fondskennzahlen - Performance, Renditeeffekte & Risiko

Seminarinhalte

Das Seminar stellt die Anforderungen für Renditenberechnung und -beschreibung systematisch und detailliert dar und durchleuchtet die Auswirkungen auf Anleger und Kundenberater. Der Lehrgang vertieft das Verständnis für Renditen mit und ohne Einbeziehung von Benchmarks. Er erklärt diverse Methoden und deren Darstellung in Berichten anhand von Beispielen und Übungen. Für eine umfassende Beschreibung und Analyse von Renditen werden Risikokennzahlen einbezogen. Der Kurs rundet seinen Inhalt mit diversen Rendite-Risiko-Kennzahlen ab.

THEORIE

Einführung Rendite

- Rendite im Allgemeinen
- Begriffe, Kennzahlen
- Beispiele

Gesetzliche Regelungen/ Marktstandard

Absolute Rendite

- MWR
- TWR
- Verkettung

Renditeeffekte

- Kapitaleffekt
- Währungseffekt
- Einkommenseffekt

Benchmarks

- Aktienindex
- FI-Index
- besondere Indizes

Relative Rendite

- Brinson-Fachler

Risikokennzahlen

- Sharpe
- Jensen alpha
- Beta
- Treynor
- Information ratio
- Value at Risk
- Bestimmtheitsmaß

Zielgruppe/Mitarbeiter im:

- Portfoliomanagement
- Fondscontrolling
- Projektumfeld des Fondsmanagements
- Anleger in Spezial-AIFs

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse Investmentfonds, Finanzmathematik

Seminardaten: FKN

Dauer: 1 Tag
Preis: EUR 950 (+ MwSt.)
Teilnehmer: maximal 8

Termine: 03. Dezember 2020 | 9:00 Uhr - 17:00 Uhr
LIVE-Online-Seminar