

Performanceanalyse

IDS-Akademie: 22. Mai 2012 Frankfurt/Main



Aus dem Inhalt

- Welchen Nutzen stiften Performanceanalysen dem Asset-Manager und dem Asset-Owner?
- Welche Verfahren entsprechen dem aktuellen Stand der Technik und was gibt es Neues in der Branche?
- Wie geeignet sind die am Markt verfügbaren Systeme und Dienstleistungen?
- Wie handhaben Praktiker das Thema?

Eine Veranstaltung für

- Fach- und Führungskräfte im Portfoliomanagement, Performancecontrolling und institutionellen Vertrieb von Vermögensverwaltern
- Mitarbeiter und Manager im Kapitalanlagemanagement und -controlling bei institutionellen Investoren

Programm

Warum teilnehmen?

Sie erhalten aus erster Hand von Fachexperten und Praktikern tiefe Einblicke in den aktuellen Stand der Performanceanalyse.

Sie erweitern Ihre Kenntnisse mit hohem Praxisbezug durch Betrachtung des gesamten technischen und fachlichen Umfelds der Performanceanalyse.

Sie lernen Performanceanalysen effektiv für die Steuerung und Überwachung von Kapitalanlagen oder im Vertrieb einzusetzen.

Ihre individuellen Fragen werden aus der weitreichenden Erfahrung der Referenten beantwortet.

Sie können Ihren eigenen Standort bestimmen und potentiell Handlungsbedarf erkennen.

Der Austausch mit Kollegen aus der Branche liefert Ihnen Impulse für die Weiterentwicklung im eigenen Hause.

Unterlagen

Die Teilnehmer erhalten die Seminarunterlagen im Anschluss an das Seminar in Papierform sowie jeweils ein Exemplar des Buches „Performanceanalyse in der Praxis: Performancemaße, Attributionsanalyse, Global Investment Performance Standards“ von Dr. Bernd R. Fischer.

8.30

Registrierung, Kaffee

9.00

Begrüßung und Programmübersicht
Dr. Bernd R. Fischer

9.15

Ricardo Schlundt Inglès

Multi-Level-Attribution

- Klassische One-Level-Attribution
- Herausforderungen bei der Multi-Level-Attribution
- Lösungsansätze
- Anwendungen

10.00

Kaffeepause

10.15

Dr. Ulrich Raber

Performanceattribution zur Unterstützung des Investmentprozesses

- Brinson-Performanceattribution
- Modellbasierte Performanceattribution
- Vor- und Nachteile bestandsbasierter Attribution
- Interaktion zwischen (ex post) Performanceattribution und (ex ante) Risikoanalyse
- Beispielanalysen

11.15

Kaffeepause

11.30

Dr. Bernd Hübinger

Beitragsanalyse bei gemischten Mandaten und Dachfonds

- Ziele und Zielgruppen der Analyse
- Messung der Assetallokation

- Allokation vs. Selektion
- Behandlung von Derivaten

12.15

Gemeinsames Mittagessen

13.45

Dr. Carsten Wittrock

Auf-/Ausbau einer sachgerechten Performanceattribution

- Grundsätzliche Überlegungen zur Implementierung einer aussagekräftigen Performanceattribution
- Wesentliche methodische Aspekte der Attribution
- Auswahlprozess von Vendors und Dienstleistern: Vorgehensmodell und Erfahrungswerte

14.30

Kaffeepause

14.45

Christian Schmidlin

Aspekte aus der Praxis

- Herausforderungen bei der Einführung einer Performanceattribution
- Auswahlprozess: „make or buy“
- Einsatz und Grenzen der Performanceattributionsanalyse bei Swisscanto

15.15

Dr. Bernd R. Fischer

- Abschließende Betrachtungen zu den einzelnen Methoden
- Einordnung des Managed-Service-Ansatzes
- Ausblick

16.00

Ausklang und Ende der Veranstaltung

Referenten

Dr. Bernd R. Fischer

Dr. Fischer ist seit 2009 Geschäftsführer der IDS GmbH – Analysis and Reporting Services (IDS). Von 2000 bis 2009 war er Global Head of Risk Controlling and Compliance im Zentralen Geschäftsfeld Asset Management der Commerzbank AG und Leiter des Bereichs Risk and Performance Controlling in der cominvest GmbH. Dr. Fischer studierte bis 1989 Physik und Mathematik an der Universität Köln. 1995 promovierte er an der Florida Atlantic University (USA). Er ist Verfasser des Standardwerks „Performanceanalyse in der Praxis“.



Dr. Bernd Hübinger

Dr. Hübinger ist seit 2002 bei IDS als Head of Retail Analysis and Reporting tätig. Dort verantwortet er für den IDS-Kunden Allianz Global Investors die Betreuung des Retail-Segments in Europa. Zuvor leitete er die Bereiche Portfoliocontrolling und Investmentprozessanalyse des dit. Dr. Hübinger studierte Physik an der Goethe-Universität in Frankfurt/Main und promovierte zu einem Thema der Nichtlinearen Dynamik.



Dr. Ulrich Raber

Dr. Ulrich Raber ist seit 2010 Leiter des Bereichs Risk Analytics, Asset Manager and Reporting Services der IDS. Er ist seit 2001 bei IDS tätig und hat die Risikoanalyse-Dienstleistungen für internationale Asset Management-Kunden maßgeblich mit aufgebaut. Zuvor war er im Bereich Performance, Risiko und Reporting der Allianz Asset Management GmbH tätig. Dr. Raber studierte Wirtschaftsmathematik an der Universität Trier und schloss dort seine Promotion zum Dr. rer. nat. 1999 ab.



Ricardo Schlundt Inglês

Ricardo Schlundt Inglês ist seit 2009 bei IDS im Bereich Performanceattribution verantwortlich für Methodologie, Produktentwicklung und Datenqualität. Zuvor forschte er an der Ruprecht-Karls-Universität Heidelberg. Herr Schlundt Inglês studierte an der Technischen Universität Lissabon, Portugal, am Instituto Superior Técnico und schloss mit Diplom in Angewandter Mathematik und Computation ab. An der University of Cambridge, UK, graduierte er als Master of Advanced Study in Mathematics.



Christian Schmidlin

Christian Schmidlin leitet seit 2008 als Chief Risk Officer das Risikomanagement und die Performanceanalyse bei Swisscanto. Zuvor war er Risiko-Controller der Schweizerischen Unfallversicherung SUVA und Leiter des gruppenweiten Kosten-Controllings bei der AXA (Winterthur Leben). Christian Schmidlin studierte Physik an der Schweizerischen Technischen Hochschule in Zürich. 2004 erlangte er den Titel Financial Risk Manager (FRM) der Global Association of Risk Professionals (GARP). 2006 beendete er das Executive MBA an der Hochschule St. Gallen.



Dr. Carsten Wittrock

Dr. Wittrock ist Partner der auf Finanzdienstleistungsunternehmen spezialisierten Unternehmensberatung zeb/rolfes.schierenbeck. associates GmbH und ist dort u. a. für den Geschäftsbereich Treasury & Capital Markets verantwortlich. Dort berät zeb/ u. a. KAGen und Investoren insbesondere in Fragen des Asset- und Risikomanagements, Investmentcontrollings und Reportings sowie des Vertriebs. Dr. Wittrock ist Verfasser des Buches „Messung und Analyse der Performance von Wertpapierportfolios“.



Anmeldung und Teilnahmebedingungen

Veranstaltungsort

The Westin Grand Frankfurt
Konrad-Adenauer-Straße 7
60313 Frankfurt am Main
www.westingrandfrankfurt.com

Teilnahme und Anmeldung

Teilnahmegebühr: 395 EUR¹ zzgl. MwSt.
Anmeldeschluss: 30.04.2012

Weitere Informationen zum Seminar
finden Sie auf
www.ids-akademie.de

Fünf Wege zur Anmeldung

Web www.ids-akademie.de
Telefon +49.89.3800 12021
Fax² +49.89.3800 15150
E-Mail
ids-akademie@investmentdataservices.com
Post
IDS GmbH – Analysis and Reporting Services
IDS-Akademie
z. H. Christine Faber
Königinstraße 28, 80802 München

Veranstalter

IDS GmbH – Analysis and Reporting Services
IDS-Akademie
Königinstraße 28, 80802 München
Telefon +49.89.3800 12021
info@investmentdataservices.com
www.InvestmentDataServices.com

Geltungsbereich

Voraussetzung für die Teilnahme sind unsere derzeit gültigen Teilnahmebedingungen. Der Teilnehmer erkennt mit seiner Anmeldung diese Teilnahmebedingungen an. Abweichende Allgemeine Geschäftsbedingungen des Teilnehmers haben keine Gültigkeit.

Teilnahmegebühr

Die Teilnahmegebühr beinhaltet die Teilnahme für eine Person. Sie versteht sich inkl. schriftlicher Unterlagen, Mittagessen und Tagungsgetränken zzgl. MwSt. Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung und eine Rechnung. Diese ist direkt nach Erhalt, aber in jedem Fall vor Eintritt in die Veranstaltung fällig.

Anmeldung

Die Anmeldung kann schriftlich via Internet, E-Mail, Fax, per Post oder mündlich per Telefon erfolgen. Sie ist, vorbehaltlich gesetzlicher Widerrufsrechte, verbindlich. Jede Anmeldung erlangt erst durch schriftliche Bestätigung seitens des Veranstalters Gültigkeit. Die Veranstaltungsteilnahme setzt die vollständige Bezahlung der Teilnahmegebühr voraus.

Urheberrecht

Alle im Rahmen der Veranstaltungen ausgegebenen Unterlagen sowie anderweitig erworbene Artikel sind urheberrechtlich geschützt. Vervielfältigungen und anderweitige Nutzung sind schriftlich durch den Veranstalter zu genehmigen.

Rücktritt des Teilnehmers

Sollte der Teilnehmer an der Teilnahme verhindert sein, so ist er berechtigt jederzeit ohne zusätzliche Kosten einen Ersatzteilnehmer zu benennen. Darüber hinaus ist eine vollständige Stornierung bis 30 Tage vor Beginn der Veranstaltung kostenlos möglich. Die Stornierung bedarf der Schriftform. Bei späterem Rücktritt oder Nichterscheinen wird die gesamte Teilnahmegebühr fällig.

Programmänderungen und Absagen

Der Veranstalter behält sich vor, Änderungen am Inhalt des Programms vorzunehmen sowie angekündigte Referenten zu ersetzen und zu streichen, sofern der Gesamtcharakter der Veranstaltung gewahrt bleibt. Muss eine Veranstaltung aus wichtigem Grund oder aufgrund höherer Gewalt (kriegerische Auseinandersetzungen, Unruhen, terroristische Bedrohungen, Naturkatastrophen, politische Beschränkungen, erhebliche Beeinflussung des Transportwesens usw.) abgesagt oder verschoben werden, so wird der Veranstalter die zu diesem Zeitpunkt angemeldeten Teilnehmer umgehend schriftlich oder mündlich benachrichtigen. Bereits eingegangene Zahlungen werden für eine zukünftige Veranstaltung gutgeschrieben oder bei einer Terminverschiebung auf den neuen Termin ausgestellt. Kosten seitens des Teilnehmers, die mit der Absage einer Veranstaltung verbunden sind (z. B. Reise- und Übernachtungskosten), werden nicht erstattet.

Haftung

Alle Veranstaltungen werden sorgfältig recherchiert, aufbereitet und durchgeführt. Sollte es dennoch zu Schadensfällen kommen, so übernimmt der Veranstalter keine Haftung für die Vollständigkeit und inhaltliche Richtigkeit in Bezug auf die Vortragsinhalte und die ausgegebenen Unterlagen.

Datenschutz

Überlassene persönliche Daten behandelt der Veranstalter in Übereinstimmung mit den geltenden datenschutzrechtlichen Bestimmungen. Sie werden zum Zwecke der Leistungserbringung elektronisch gespeichert. Einblick und Löschung der gespeicherten Daten kann jederzeit gefordert werden.
Anfragen bitte per E-Mail an:
ids-akademie@investmentdataservices.com

Schlussbestimmungen

Die Teilnahmebedingungen unterliegen deutschem Recht. Gerichtsstand ist München.

¹ BVI-Mitglieder erhalten einen Preisnachlass von 20%

² Für Anmeldungen per Fax verwenden Sie bitte die beigelegte PDF-Vorlage.