



Seminar

GRUNDLAGENSEMINAR

Einführung in die Performancemessung

Mit dem Seminar vermitteln wir Ihnen kompakt einen Überblick über die wesentlichen Elemente der Performancemessung. Sie lernen zum einen die Grundlagen wie die BVI-Methode der Wertentwicklungsberechnung kennen und zum anderen unterschiedliche Methoden, wie eine

Wertentwicklung differenziert dargestellt und nach bestimmten Faktoren gewichtet werden kann. Erläutert werden auch Aspekte wie Risiko, Value at Risk, Volatilität sowie die GIPS-Performance Presentation Standards, die insbesondere bei Fonds für institutionelle Anleger Anwendung finden.

Das Seminar findet statt am

Dienstag, 7. Mai 2019

10:00 Uhr bis ca. 13:00 Uhr (ab 9:30 Uhr Registrierung der Teilnehmer)

BVI

Konferenzetage 6. Stock

Bockenheimer Anlage 15

60322 Frankfurt am Main

10:00 Uhr	<p>Grundlagen und Ziele der Performancemessung</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ Methoden: Time Weighted Return (TWR) Money Weighted Return (MWR) ▪ BVI-Methoden für offene und geschlossene Fonds ▪ Berechnungsbeispiele <p>Renditeattribution</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ Klassische Verfahren ▪ Faktorbasierte Verfahren ▪ Beispiele
11:15 Uhr	Kaffeepause
11:45 Uhr	<p>Risikoadjustierte Performancemessung</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ Risikokennziffern ▪ Methoden
12:15 Uhr	GIPS-Standards zur Performance-Präsentation

12:30 Uhr **Grenzen der Performancemessung und zukünftige Entwicklungen**

ca. 13:00 Uhr **Ende des Seminars**

Referent: Hans G. Pieper, DPG Deutsche Performancemessungs-Gesellschaft für Wertpapierportfolios mbH

Zielgruppe

- **Für Teilnehmer ohne Vorkenntnisse**
- ■ Für Teilnehmer mit Vorkenntnissen
- ■ ■ Für Teilnehmer mit speziellen Fachkenntnissen

Anmeldung

Die Teilnahme an dem Seminar kostet **230,00 Euro** für BVI-Mitglieder und **460,00 Euro** für Nicht-Mitglieder jeweils zzgl. Mehrwertsteuer. Der Kostenbeitrag enthält die Seminarunterlagen und das Mittagessen.

BITTE BEACHTEN SIE FOLGENDE REGELUNG:

Bei Abmeldung nach Ablauf der Stornierungsfrist (5 Werktage vor der Veranstaltung) müssen wir leider den Kostenbeitrag in voller Höhe in Rechnung stellen. Alternativ können Sie einen Vertreter benennen.

Hinweise zum Datenschutz

Der BVI erhebt, verarbeitet und nutzt Ihre Daten, insbesondere Ihre berufliche Adresse, Ihre Rechnungsadresse sowie E-Mail-Adresse im Zusammenhang mit Ihrer Teilnahme an der BVI-Veranstaltung. Zur Nutzung zählt neben der Übermittlung von Informationen zur Veranstaltung an Sie auch die Rechnungsstellung. Beachten Sie hierzu unsere Datenschutzerklärung (<https://www.bvi.de/datenschutz/datenschutzerklaerung/>)