

Investment Reporting & Performance Evaluation

Ein Fachlehrgang für die Praxis

Der apex Fachlehrgang «Investment Reporting und Performance Evaluation» richtet sich an Mitarbeitende in der Finanzindustrie, welche sich mit der Messung, Analyse, Interpretation, Beurteilung und Darstellung der Entwicklung von Vermögensanlagen beschäftigen.

Fokus des Fachlehrgangs ist nicht nur das Vermitteln und Anwenden von Fachwissen, sondern auch die Darstellung der grossen Zusammenhänge zwi-

schen den einzelnen Fachgebieten. Die ganzheitliche Betrachtung und situationsspezifische Anwendung ist zentral für ein effektives Investment Reporting und ein entscheidungsorientiertes Investment Controlling.

Dieses ganzheitliche Lehrkonzept ist eine wichtige Besonderheit des Fachlehrgangs. Die Teilnehmenden werden ihr Fachwissen und ihre Erfahrungen nachhaltig ausbauen.

Organisation

Dauer	5 Unterrichtstage, jeweils montags von 9 bis ca. 16 Uhr
Termine	9.11., 16.11., 23.11., 30.11. und 7.12.2020
Kursort	KV Business School Zürich AG (beim HB), Bildungszentrum Sihlpost, Sihlpostgasse 2, Zürich Raum SI 109 Corona: Die Durchführung des Lehrgangs ist über grosse Räume oder bei Bedarf auch online sichergestellt. Bitte beachten Sie, dass in allen öffentlich zugänglichen Bereichen wie Flur, Begegnungszonen oder Toiletten eine vom Kanton Zürich verordnete Maskenpflicht gilt. Im Schulungsraum darf auf das Tragen der Maske verzichtet werden, da der Mindestabstand gewährleistet ist.
Gruppengrösse	Maximal 15 Teilnehmende
Kursunterlagen	Die Kursunterlagen sind auf Deutsch sowie teilweise auf Englisch und werden als PDF zur Verfügung gestellt.
Kurssprache	Deutsch
Bestätigung	Am Ende des Fachlehrgangs bestätigen wir Ihnen die Teilnahme.
Kosten	CHF 3'370.-
Referent	Dr. Oliver Gloor
Anmeldung	seminare@apex-rs.ch bis 23.10.2020
Annulation	Bis zum 23.10.2020 kostenlos. Ab dem 24. bis 31.10.2020 50% der Kurskosten.

Inhalte

Der Lehrgang umfasst die vertiefte Behandlung der Bereiche Investment Reporting und Performance Evaluation und ist wie folgt gegliedert:

Definition und Einführung

- Weshalb Investments?
- Weshalb Investment Reporting?
- Weshalb Performance Evaluation?

Grundlagen

- Märkte und Diversifikation
- Finanzinstrumente

Kennzahlen und ihre Berechnung

- Renditeberechnung, u.a.
 - MWR, TWR, ...
- Risikomasse, u.a.
 - Volatilität, VaR, ...
- Risikoadjustierte Renditemessung
- Benchmarking, u.a.
 - Berechnung von Benchmarkrenditen
 - Relative Risikomasse
- Attribution, u.a.
 - Contribution vs. Attribution
 - Rendite vs. Risiko
 - Entscheidungs- vs. Faktororientierte Attribution

Prozesse

- Anlageprozesse
- Investment Reporting Prozesse

Daten

- Datenqualität
- Datenmanagement

Investment Reports (Output)

- Report Definition
- Aufbau, Adressaten und die Auswahl der Information
- Standard-Report
- High-End-Report

Best Practise

- Transparenz
- Fairness
- Principles for Investment Reporting (PIR)
- Guidance to Effective Investment Reporting (EIR)

Theoretische und praktische Inhalte wechseln sich ab. Gerne gehen wir beim Setzen von Schwerpunkten auch auf die Vorkenntnisse und Interessen der Teilnehmenden ein – demzufolge sind auch Änderungen im Programm möglich.

Viel Spass beim Eintauchen in die verschiedenen Themen!