



ASSET ALLOKATION & INVESTITIONS- STRATEGIEN FÜR ANLAGEKOMMISSIONEN

Freitag, 15. September 2017

HSG-Trading Room | Universität St.Gallen



Motivation

Portfoliomanagement innerhalb definierter Bandbreiten, wertschaffende Asset Allokation und verantwortungsvoller Umgang mit Risiken sind zentrale Herausforderungen von Anlagekommissionen. Fundiertes Expertenwissen über Marktdynamiken, Fundamentalwert & Quantitative Analysetechniken ist dabei unabdingbar.

Effiziente und erfolgreiche Anlageentscheide bei gleichzeitig stark reguliertem Umfeld erfordern:

- Kenntnis über Zielgrößen und Vorgaben für Anlagekommissionen
- Urteilsvermögen in Bezug auf Mikro- & Makroindikatoren und implizierte Steuerungsmassnahmen
- Fundierte Marktanalyse und aktive Asset Allokation unter Berücksichtigung massgeblicher Währungs-, regionaler und sektoraler Einflussfaktoren
- Verlässliche Einschätzung der Auswirkungen von Anlageentscheidungen auf Rendite und Risiko unter Massgabe der Marktdynamiken
- Kenntnis über Einfluss von Gebühren und Handelskosten auf Asset Allokation und Rebalancing
- Aufnahme und Umgang mit Handlungsempfehlungen Dritter

Eine Schlüsselrolle für den Lernerfolg nimmt der HSG Trading Room ein, ein High-Tech Trading Floor, ausgestattet mit State of the Art Trading Software und Zugang zu einschlägigen Datenbanken wie Thomson Reuters und Bloomberg. Die direkte Anwendung quantitativer Konzepte auf reale Marktdaten ist Kernelement aktiven, erfahrungsorientierten Lernens.

Lernziele

- Optimierung der Taktischen Asset Allokation unter strategischen Rahmenbedingungen
- Taktische Steuerung von Anlageklassen, Sektoren, Regionen und Währungen
- Verständnis für Fundamentalwert, Marktbewertung und Diversifikation
- Beurteilung von Indikatoren und Signalen für die Asset Allokation
- Ableiten von Implikationen für Rendite, Risiko und Reserveanforderungen

Zielgruppe

Der Workshop richtet sich an Mitglieder von Anlagekommissionen institutioneller Anleger, insbesondere Pensionskassen, Personalvorsorgestiftungen, Versicherungsunternehmen, Unternehmen, soziale Stiftungen und Non-Profit-Unternehmen sowie Family Offices.

Referenten



Prof. Dr. Karl Frauendorfer

Ordinarius für Operations Research | School of Finance
Direktor des Instituts für Operations Research und Computational Finance
(ior/cf-HSG) | Universität St.Gallen



Prof. Robert Gutsche, Ph.D.

Assistenzprofessor für Finanz- und Rechnungswesen |
School of Management | Institut für Operations Research und
Computational Finance (ior/cf-HSG) | Universität St.Gallen



Jeannette Leuch, MBA

Partnerin | Investment-Controlling, Anlagestrategie, Anlageorganisation,
Risikomanagement und Governance-konforme Ausgestaltung von
Kapitalanlagen | invalue ag St.Gallen

Programm

ab 08:15	Willkommenskaffee
08:45 – 10:15	Anlagekommission und Investitionsentscheide <ul style="list-style-type: none">■ Handlungsspielräume■ Strategie und Taktik■ Regulatorisches Umfeld Case Study: Schweizer Pensionskasse
10:15 – 10:30	Kaffeepause
10:30 – 12:00	Marktdynamik und Bewertung <ul style="list-style-type: none">■ Fundamentalbewertung und Quantitative Analysetools■ Aktien, Obligationen & Alternative Investitionsstrategien■ Risiken im negativen Zinsumfeld Trading Case: Investment Research
12:00 – 13:30	Mittagessen
13:30 – 15:00	Portfolio Steuerung <ul style="list-style-type: none">■ Diversifikation und Rebalancing■ Taktische Umsetzungen■ Auswirkungen der Portfoliosteuerung Trading Case: Anlageentscheidungen in der Anlagekommission
15:00 – 15:15	Kaffeepause
15:15 – 16:45	Trading Session Trading Case: Portfoliomanagement und -performance
16:45 – 17:00	Zusammenfassung und Fazit

Organisatorisches

Registrierung

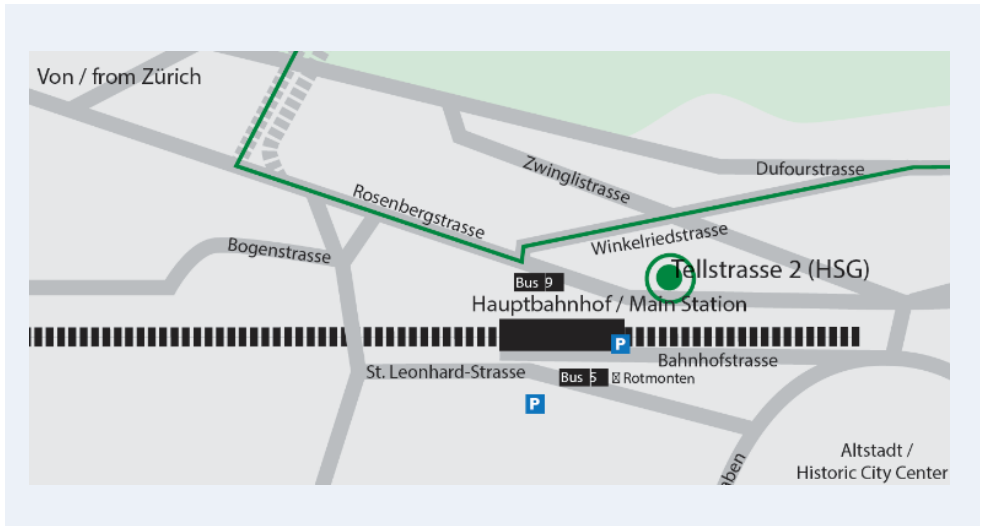
- Anmeldungen sind ab sofort bei Sabrina Frei möglich:
sabrina.frei@unisg.ch | Telefon +41 (0)71 224 21 04 | Fax +41 (0)71 224 21 02

Seminarpauschale

- Die Kosten für das Seminar betragen CHF 1'200.– pro Person inkl. Dokumentation und Verpflegung.
- Die Rechnung über die volle Seminarpauschale wird nach der Veranstaltung per Post zugestellt.
- Auf Verlangen wird eine Teilnahmebestätigung ausgestellt.

Ort

Universität St.Gallen | HSG- Trading Room
Tellstrasse 2 | 9000 St.Gallen



Anmeldetalon

Asset Allokation & Investitionsstrategien für Anlagekommissionen

Freitag, 15. September 2017 | Universität St.Gallen | HSG-Trading Room

Vorname/Name

Firma bzw. Organisation

Funktion

Strasse/Nummer

PLZ/Ort

Land

E-Mail

Telefon

Ort/Datum

Unterschrift

Bitte einsenden an: Sabrina Frei | sabrina.frei@unisg.ch | Fax +41 (0)71 224 21 02



"From insight
to impact" 