

> Auf einen Blick

Zielpublikum Finanzpraktiker aus Anlageberatung, Asset- und Portfoliomanagement, Finanzanalyse, Risikomanagement, Wertpapier- und Devisenhandel, Revision, Kommerzgeschäft und anderen Bereichen sowie anspruchsvolle Privatinvestoren

Kursort SWX Swiss Exchange
ConventionPoint
Selnaustrasse 30
8021 Zürich

Kursdauer 10 Veranstaltungen im Zeitraum vom 25. April 2005 bis 27. Juni 2005 zu jeweils 90 Minuten (17.30 bis 19.00 Uhr)

Kosten CHF 1200 inkl. optionale Zertifikatsprüfung, Kursunterlagen und Aperitive nach dem ersten und letzten Kursabend

Schulungen sind nicht mehrwertsteuerpflichtig.

Anmeldung und weitere Informationen Bitte verwenden Sie das beiliegende Fax-Anmeldeformular.

Algofin AG
Herr Michael Verhofen
Blumenbergplatz 7
CH-9000 St. Gallen
T +41 71 535 05 00
F +41 71 535 05 01
michael.verhofen@algofin.com
www.algofin.com

> Professional Wealth Management

Vortragsreihe unter der Leitung von
Prof. Dr. Manuel Ammann
Universität St.Gallen

> **Beginn**
25. April 2005

> **Kursort**
SWX Swiss Exchange
ConventionPoint
Zürich

Durchgeführt vom
Fit for Finance
Team

Inhalt Der Kurs «Professional Wealth Management» vermittelt einen umfassenden Überblick über die wichtigsten Themen im Asset- und Wealth Management. Im Vordergrund steht dabei der gegenwärtige State-of-the-Art in Theorie und Praxis.

Thema 1 Portfoliotheorie in der Praxis
(Prof. Dr. Manuel Ammann)
Montag 25.04.05 Portfoliooptimierung und CAPM, Schätzprobleme, Resampling, Länder- und Branchendiversifikation

Thema 2 Strategische Asset Allokation und Indexing
(Stephan Kessler, Dipl.-Kfm.)
Montag 02.05.05 Aktives vs. passives Portfoliomanagement, Tracking Error, Core-Satellite-Ansatz, Reverse Optimization

Thema 3 Taktische Asset Allokation
(Michael Verhofen, lic. oec. HSG)
Montag 09.05.05 Black-Litterman-Ansatz, Market Timing, Sektor Rotation, Konjunkturzyklen, Faktormodelle

Thema 4 Internationale Portfolioallokation
(Dr. Rico von Wyss)
Mittwoch 18.05.05 Währungsrisiken, Currency Overlay, Home Bias, Country Rotation, Emerging Markets

Thema 5 Performance-Messung und Stil Analyse
(Ralf Seiz, Dipl. Phys. ETH)
Montag 23.05.05 Benchmarks, Alpha Generation, Performance-Attribution, Sharpe Ratio, Treynor Ratio, Information Criteria

Thema 6 Risikomanagement
(Michael Verhofen, lic. oec. HSG)
Montag 30.05.05 Value-at-Risk, Shortfall, Monte Carlo Simulation, Stress Testing, Global Risk Factors, Risk Budgeting

Thema 7 Derivate im Asset Management
(Ralf Seiz, Dipl. Phys. ETH)
Montag 06.06.05 Risikotransfer, Portfolio Insurance, CPPI, Einsatz von strukturierten Produkten

Thema 8 Bondportfoliomanagement
(Dr. Axel Kind)
Montag 13.06.05 Bondindexing vs. aktives Bondportfoliomanagement, Zinsrisiken und Duration, Kreditrisiken

Thema 9 Vermögensplanung im Lebenszyklus
(Dr. Rico von Wyss)
Montag 20.06.05 Zeithorizonteffekte, Life Cycle Investing, Asset- und Liability Management, Altersvorsorge

Thema 10 Alternative Investments
(Prof. Dr. Manuel Ammann)
Montag 27.06.05 Hedge Funds und Private Equity, Diversifikations- und Performance-Effekte, Allokation und Risiken

Optional Zertifikatsprüfung
Donnerstag 30.06.05 Bei Bestehen der Prüfung wird ein Zertifikat ausgestellt