

Fachbeitrag in Ausgabe 05/2018

VON PROF. DR. DR. THOMAS DANGL UND MAG. JURAJ KATRIAK



Risikosteuerung mit Conditional Value at Risk

Der Conditional Value at Risk hat eine Reihe von vorteilhaften Eigenschaften und eignet sich besonders zur Messung von Downside-Risiken in der Portfoliosteuerung. Am Beispiel der Spängler IQAM Invest stellen Prof. Dr. Dr. Thomas Dangel und Mag. Juraj Katriak die Gründe für eine Umstellung der Risikosteuerung sowie die konkrete Vorgehensweise dar.

inhalt 05/2018



kommentar

FRANK DORNSEIFER BAI
ULRICH LINGNER Helaba Invest

artikel

Absolute Return mit Alternativen Risikoprämien

ERIC QUAST Signal Iduna Asset Management

EZB–Quantitative Straffung: Szenarien und Auswirkungen auf Fixed-Income-Anlagen

PIETER JANSEN NN Investment Partners

Risikosteuerung mit Conditional Value at Risk

PROF. DR. DR. THOMAS DANGL, MAG. JURAJ KATRIAK Spängler IQAM Invest GmbH

Anlageklasse soziale Infrastruktur – Entwicklung in Europa

STEFAN BAUER Franklin Templeton, RAYMOND JACOBS Franklin Real Assets Advisors

Mikrowohnen – Chancen für institutionelle Anleger

JOHANNES ANSCHOTT Commerz Real AG

Asset-Backed Securities – Entmystifizierung einer Anlageklasse

BEN HAYWARD TwentyFour Asset Management

Aktuelle Entwicklungen der Investmentbesteuerung

SARAH GÖRKE BayernInvest Kapitalverwaltungsgesellschaft mbH

drei fragen an

ROLAND VOGEL Finanzvorstand – Hannover Rück SE

Ja, ich bin institutioneller Investor* und möchte den Absolutreport 05/2018 als **kostenloses** Leseexemplar anfordern.

Kein Investor? Gerne senden wir Ihnen Informationen zu unserem Jahresabonnement zu.

Bitte senden oder faxen an:
info@absolut-research.de
+49 40 303779 -15

Absolut Research GmbH
Große Elbstraße 277a, 22767 Hamburg

Datenschutzrichtlinien: www.absolut-research.de/datenschutz

*Als institutionelle Investoren qualifizieren sich nur Unternehmen, die ausschließlich für eigene Zwecke investieren und die keine Produkte im institutionellen Asset Management anbieten.

Vorname/Nachname

Bereich/Funktion

Unternehmen

Straße/Nr.

PLZ/Ort

Tel./Fax

E-Mail

Besuchte Veranstaltung