



Performanceanalyse ALS Steuerungsinstrument Im Wertpapier-Managementprozess

Frank Wolfert



Ziel dieser Arbeit ist es, die Bedeutung der Performanceanalyse als aktives Steuerungsinstrument im Wertpapier-Asset Management aufzuzeigen. Aufbauend auf der Kapitalmarkttheorie und bekannter Methoden der Performancemessung und -analyse wird ein dynamisches System zur Bestimmung des Risiko- und Renditebeitrags fundamentaler Einflussfaktoren entwickelt. Erfolgsentscheidend ist dafür die anteilige Faktorzuordnung auf Wertpapiere, während in der klassischen Performanceanalyse eindeutige Beziehungen von Wertpapieren z.B. zu Sektoren bestehen. Die dynamische, auf mehrdimensionalen Risikopositionierungen beruhende Performanceanalyse wird so integraler Bestandteil im Managementprozess und ermöglicht damit eine planungs- und entscheidungsbegleitende, zeitnahe Steuerung.

- [The Perils of Beauty, Volume 1](#)
- [Perfiles : Mujeres de La Guerra Civil Espanola En Cuba](#)
- [Per Crucem Ad Lucem : The Result of a Life, Volume 1](#)
- [Pergamon : Geschichte und Bauten einer antiken Metropole](#)
- [People without Government : An Anthropology of Anarchy](#)
- [Perfect Gentleman](#)
- [A People and a Nation Volume B Brief Fifth Edition and Wheeler Discovering American Past Volume 2 Fifth Edition and Getting the Most from Us History Guide Vade Mercurum](#)
- [A People and a Nation Complete Brief Sixth Edition with History C D ROM and Atlas](#)
- [Perdon Imposible : Guia Para Una Puntuacion Mas Rica y Consciente](#)