



# Portfolio Management SIM<sup>95</sup>

Erfolgreiches Führen eines Vermögensverwaltungsinstituts in einem äusserst herausfordernden Marktumfeld.

## KURZBESCHREIBUNG

Im Portfolio Management SIM<sup>95</sup> führen Teilnehmende eine Abteilung für Portfolio Management. Teams bis zu 4 Personen sind einerseits verantwortlich für die strategische und taktische Asset Allocation ihrer Kundenportfolios sowie der dazu notwendigen operativen Entscheidungen. Jedes Team ist in Konkurrenz mit anderen Unternehmen, die den gleichen Markt bearbeiten und versuchen, die beste Performance und den höchsten Profit für ihre Kunden zu erzielen. Über die Dauer von bis zu 12 Geschäftsperioden treffen die Teilnehmenden ihre Entscheidungen in Übereinstimmung mit den Markt- und Konjunkturprognosen. Der Erfolg hängt erheblich von ihrer Fähigkeit ab, die Marktveränderungen vorwegzunehmen und daraus die notwendigen Schritte abzuleiten, um von diesen Änderungen am besten zu profitieren. Das gelingt besonders gut, wenn das Wissen und die Managementfähigkeit jedes Teilnehmenden ideal eingesetzt und kombiniert werden. Der Portfolio Management SIM<sup>95</sup> zugrunde liegende Daten sind echte Marktdaten der Schweiz, USA, Europa, Japan und Emerging Markets (China). Die Simulation wurde in Zusammenarbeit mit dem Bankeninstitut der Universität von Zürich und der Portfolio Managementabteilung der Bank Julius Baer entwickelt.

## LERNZIELE

- Erlernen und verbessern des Verständnisses über die Wesensmerkmale des modernen Portfolio Managements
- Erkennen der Parameter, warum die Asset Allocation der Schlüssel für eine gute Performance ist
- Verstehen der Zusammenhänge des Portfolio Managements und der Volkswirtschaft und entwickeln von Fähigkeiten, um diese im Berufsleben anzuwenden bzw. zu integrieren
- Erlernen, wie man Entscheidungsprozesse in einer strukturierten Art optimiert und diese Grundregeln im Berufsalltag umsetzt
- Erkennen und begreifen der strategischen Erfolgsfaktoren im Portfolio Management und diese als Portfeuille-Verwalter anwenden





© 2012 game solution ag. Alle Rechte vorbehalten.

Überblick Simulation

- Entscheidungsparameter strategische / taktische Asset Allocation
- Entscheidungsparameter Depotrealisierung  
(Kundentypen konservativ/dynamisch)
- Entscheidungsparameter Managemententscheidungen  
(Gebühren, Kommissionen, Marketing, HR und Logistik)

**METHODIK**

In der computergestützten Simulation treffen die Teilnehmenden Entscheidungen aufgrund ihrer Einschätzung der Konjunkturprognose und auf der Grundlage von zukünftigen Erwartungen und der vorhandenen Marktlage. Die Entscheidungen geben die Teams in die Eingabemasken ein: Zuerst stellen sie die strategische und taktische Asset Allocation fest und entscheiden dann über operative Entscheidungen wie Marketing, Personalmanagement und Logistik. Dank dem Vorkalkulationsmodell können die eigenen Entscheidungen berechnet und vor der finalen Eingabe weitere Änderungen zur Optimierung vorgenommen werden. Sobald die Teams ihre abschliessenden Entscheidungen getroffen haben, reichen sie diese dem Spielleiter ein und die Simulation wird unter Berücksichtigung der Entscheidungen aller teilnehmenden Teams errechnet. Nach den einzelnen Simulationsrunden wird der Erfolg der Portfolios jeder Abteilung gemessen und mit dem Gesamtmarkt, einem Benchmark-Portfolio und den anderen Mitbewerbern verglichen. Jedes Team erhält einen ausführlichen Bericht über seine Leistungen, aufgeteilt in die verschiedenen Kundensegmente und für jedes Entscheidungsfeld.

**ZIELPUBLIKUM**

- Anlage-, Vermögens- und Finanzberater
- Führungsnachwuchskräfte / Trainees in Banken und Finanzgesellschaften
- Kaderleute und Mitarbeitende im Back-Office-Bereich von Finanzinstituten
- Externe Vermögensverwalter / Aussendienstmitarbeiter im Allfinanzsektor

**ANWENDUNG**

- 8 bis 200 Personen von 2 bis 5 Tagen à jeweils ca. 8 Stunden
- Auch als Fernplanspiel möglich

**SPRACHEN**

- Deutsch
- Englisch
- Weitere Sprachen auf Anfrage



Entscheidungsparameter Asset Allocation



Entscheidungsparameter Managemententscheidung