

# Performance

## PMS Performance Measurement

- Global Investment Performance Standards
- Bestands- und Transaktions-basiert
- Zeit- und Geldgewichtete Rendite
- Ergebnishierarchie von Portfolio zu Positionen

## PMS Performance Attribution

- Für Aktien und Rentenportfolien
- Brinson, Fachler, Hood, Beebower, Campisi
- Selektion, Allokation, Währungs usw. Effekte
- Arithmetische and Geometrische aktive Rendite
- Berücksichtigung von Derivaten

## PMS Risiko/Performance Kennzahlen

- Risiko-adjustierte Performancekennzahlen
- Benchmarking: Tracking Error usw.
- Rendite-Verteilungen, Regressionsanalyse
- Ex-Post und Ex-Ante Kennzahlen
- Downside Risiko Kennzahlen
- Drawdown Analyse mit Kennzahlen