

Enhanced Indexing und quantitatives Asset Management – Lösungsansätze für Aktienanlagen

Einleitung in die Thematik

Graziano Lusenti

Strategischer Berater für institutionelle Anleger
Dr. rer. pol. (internationale Beziehungen),
Dipl. Pensionskassenexperte (Versicherungsmathematiker)
Managing Partner, Lusenti Partners, Nyon (VD)

Zürich, 14. Juni 2006

Themen I

1. Ein abflauernder Religionskrieg ? Aktives *gegen* passives (indexiertes) Asset Management
2. Die Vorteile eines gelungenen Gleichgewichtes: Der *core/satellite* Anlageansatz, aktive *und* indexierte Vermögensverwaltung, das Entwickeln und Umsetzen eines ausgeklugelten Gleichgewichtes
3. Die wichtigsten Argumente zugunsten der indexierten Vermögensverwaltung
4. Die indexierte Vermögensverwaltung eignet sich nicht für sämtliche Anlagekategorien

Themen II

5. Gründe für Verbreitung der quantitativen Vermögensverwaltung
6. *Enhanced Indexing*: Eine Alternative zur aktiven und/oder zur indexierten Vermögensverwaltung ?
Wie kann man *enhanced indexing* erfolgreich umsetzen und im Investitionsprozess vorteilhaft integrieren ?
7. Die zahlreichen Facetten des *enhanced indexings* und der quantitativen Vermögensverwaltung

Themen III

8. Einige Statistiken: Die Schweizer Institutionellen und die indexierte Vermögensverwaltung: Angaben aus dem *Swiss Institutional Survey*, am 31.12.2002 und am 31.12.2004

Motivation zur aktiven/passiven Vermögensverwaltung, Anzahl Antworten, sämtliche Institutionen (31.12.2004)

