



2., aktualisierte Aufl. 2015, XIX, 384 S. 77  
Abb., 48 Abb. in Farbe.

 Springer Gabler Druckausgabe

**Hardcover**

**Ladenpreis**

► \*44,99 € (D) | 46,26 € (A) | CHF 47.50

 eBook

**Erhältlich bei Ihrer Bibliothek  
oder**

► [springer.com/shop](http://springer.com/shop)

E. Mondello

## **Portfoliomangement**

Theorie und Anwendungsbeispiele

- **Grundlagenbuch mit dem Anspruch, vertiefenden Charakter aufzuweisen**
- **Geeignet für Bachelor- und Masterstudierende von Fachhochschulen und Universitäten im Bereich Wirtschaftswissenschaften und Praktiker im Bereich Finanzwirtschaft**
- **Besonders interessant ist dabei das komplementäre Angebot von Vorlesungsfolien und Excel-Templates für Lehrende**

Das Lehrbuch deckt sowohl die Kapitalmarktmodelle als auch deren Anwendungen im Portfoliomangement ab. Es zeigt u.a. die Berechnung der Rendite und des Risikos von einzelnen Anlagen und Portfolios, die Konstruktion der Effizienzkurve anhand des Markowitz-Modells und des Marktmodells, die Bestimmung des optimalen Portfolios mit der Effizienzkurve und den investorenspezifischen Indifferenzkurven sowie die Performancemessung von Portfolios. Das Buch beinhaltet zahlreiche Aufgaben (im Text sowie auch am Ende der jeweiligen Kapitel). Besonders von Interesse ist es somit für Dozierende und Studierende der Wirtschaftswissenschaften mit dem Schwerpunkt Finanzwissenschaften, aber auch für Fach- und Führungskräfte, die für ihren Aufgabenbereich grundlegende Kenntnisse für ein erfolgreiches Portfoliomangement benötigen oder eine Weiterbildung wie beispielsweise zum CFA® und CIAA® anstreben.

### Der Inhalt

- Grundlagen der Kapitalmarkttheorie und des Portfoliomangements
- Optimales Portfolio
- Einfaktormodelle
- Multifaktormodelle

### Der Autor

Dr. Enzo Mondello ist seit 2001 Gründer, Inhaber und Leiter von CfBS Center for Business Studies AG mit den Schwerpunkten CFA®, FRM und CAIA®. Er verfügt über eine langjährige Lehrererfahrung an Universitäten, Fachhochschulen und in CFA®-Vorbereitungskursen.



Erhältlich bei Ihrem Buchhändler oder – Springer Customer Service Center GmbH, Haberstrasse 7, 69126 Heidelberg, Germany ► Call: + 49 (0) 6221-345-4301 ► Fax: +49 (0)6221-345-4229 ► Email: [customerservice@springer.com](mailto:customerservice@springer.com) ► Web: [springer.com](http://springer.com)

\* € (D) sind gebundene Ladenpreise in Deutschland und enthalten 7% MwSt; € (A) sind gebundene Ladenpreise in Österreich und enthalten 10% MwSt. CHF und die mit \*\* gekennzeichneten Preise für elektronische Produkte sind unverbindliche Preisempfehlungen und enthalten die landesübliche MwSt. Programm- und Preisänderungen (auch bei Irrtümern) vorbehalten. Es gelten unsere Allgemeinen Liefer- und Zahlungsbedingungen.

Springer-Verlag GmbH, Handelsregistersitz: Berlin-Charlottenburg, HR B 91022. Geschäftsführung: Haank, Mos, Hendriks