

PERFORMANCEQUELLEN 2017 UND DIVERSIFIKATION ABSEITS DER TRADITIONELLEN ANLAGEKLASSEN

MITTWOCH, 16.11.2016, AB 08.45 UHR BIS CA. 13.15 UHR
PALAIS HANSEN KEMPINSKI VIENNA,
SCHOTTENRING 24, 1010 WIEN

ab **08.45 Uhr** Registrierung bei Kaffee und Tee
Begrüßung durch Mag. Martin Greil, Generalsekretär der AIFM Federation Austria

ab **09.00 Uhr bis 13.15 Uhr**
Fachvorträge mit Gabelfrühstück à la Kempinski

im Anschluss Get-together

Anmeldung bitte bis spätestens **02.11.** per Email an office@aifm-federation.at

Diese Fachtagung der AIFM Federation Austria ist eine kostenlose Informationsveranstaltung und richtet sich an Banken und Kapitalanlagegesellschaften, Dachfondsmanager und Vermögensverwaltungen, Finanzvorstände und Treasurer von Unternehmen, institutionelle Endinvestoren, Pensions- und Vorsorgekassen, Versicherungsunternehmen und Finanzjournalisten. Die Teilnehmerzahl ist beschränkt.

„Smart beta“ and the new investment landscape



Michael Steliaros, PhD
Global Head of Quantitative
Solutions, Head of EMEA
Portfolio Products Distribution,
Bank of America Merrill Lynch

- What is smart beta?
- The impact of the explosion in assets under quant and smart beta management
- Risks, crowding and trading
- Accessing smart beta through liquid alternatives

Dieser Vortrag wird in englischer Sprache gehalten.

The **Bank of America Merrill Lynch** Funds platform provides investors with access to best in class absolute return managers and innovative in-house research capabilities in a UCITS compliant structure. Launched in 2007, the platform currently has 20 UCITS funds live with a total of more than \$6bn in Assets under Management.

Absolute Return Bond Fonds - ein Fels in der Brandung



Felicita Fiala
Investment Produkt Spezialist,
Kames Capital

- Die größte Herausforderung: eine richtige Einschätzung der Anleihenmärkte
- Einfluss der Geldpolitik auf die Entwicklung der globalen Kapitalmärkte
- Neue Wege neben den klassischen benchmark-orientierten Konzepten, beispielsweise die Konzentration auf Absolute-Return-Anlagestrategien
- Marktneutrale Strategien als sinnvolle Beimischung zu einem Gesamtportfolio
- Generierung von Alpha unabhängig von den zugrundeliegenden Anleihenmärkten bei sehr niedriger Volatilität

Kames Capital - eine 100%ige Tochter von Aegon NV - ist eine spezialisierte Investment-Management-Gesellschaft, deren Unternehmensgeschichte zur Gründung der Scottish Equitable Life Assurance Society in das Jahr 1831 zurückreicht. 87 Anlageexperten verwalten in Niederlassungen in Edinburgh und London € 60 Milliarden (30. Juni 2016) für britische und internationale Kunden.

Alternative Investitionsmöglichkeiten im Fish & Seafood Sektor



Christoph Baldegger
Gründer Bonafide

- Marine Resources, Nachhaltigkeit und Impact Investment
- Nutzen für institutionelle Investoren auf einem noch weitgehend unentdeckten Markt mit interessantem Ertragspotenzial
- Fish & Seafood als wenig korrelierte Anlageklasse bietet hohe Diversifikationsmöglichkeiten
- Ein globaler Megatrend – Rolle der Food and Agriculture Organization (FAO) und Weltbank

Bonafide ist ein international renommiertes Research- und Beratungsunternehmen, das sich auf nachhaltige Fischerei und Aquakultur sowie deren Wertschöpfungskette konzentriert. Bonafide hat sich zum Ziel gesetzt, das Wachstum der nachhaltigen Fischerei und Aquakultur zu fördern und bringt daher Unternehmen der Branche mit Investoren zusammen, die das enorme Potenzial des Bereichs „Fish & Seafood“ erkannt haben.

Herausforderung Absolute Return unter Solvency II – ein Lösungsansatz



Stefan Amenda
Leitung Team Institutionelle Fonds, Emerging Markets & FX, MEAG



Wolfgang Kaiser
Leitung Mandate und Account Management
Institutionelle Kunden, MEAG

- Unter welchen Voraussetzungen wird das Absolute-Return-Management auch im Umfeld dauerhaft niedriger bzw. negativer Zinsen erfolgreich sein?
- Wie sollte das Risikobudget und das Investmentuniversum definiert sein, um eine bestimmte Zielrendite anstreben zu können?
- Welche grundsätzlichen Implikationen ergeben sich aus dem Solvency II Standardmodell auf die Kapitalanlage von Versicherungen?
- Wie könnte der Risikokapitalbedarf (Markt-SCR) limitiert werden?
- Welche Konsequenzen ergeben sich für das Portfolio Management?

Die **MEAG** steht für das Vermögensmanagement der Munich Re Gruppe. Die MEAG ist in Europa, Nordamerika und Asien präsent und bietet ihr umfassendes Know-how auch externen institutionellen Anlegern und Privatkunden an. Insgesamt verwaltet die MEAG Kapitalanlagen im Wert von rund 265 Milliarden Euro.

Ergänzungsstrategien für institutionelle Immobilienportfolios



Dr. Thomas Kallenbrunnen
Generalbevollmächtigter, Abteilungsleiter Asset Management Immobilien und Alternative Investments, Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH

- Immobilien Secondaries & Immobilien Asien
- Zugang zu voll investierten Immobilienfonds über den Sekundärmarkt
- Diversifizierter Zugang zum asiatischen Immobilienmarkt über den Multi Manager-Ansatz

Die **Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH** wurde 1991 als 100%-ige Tochtergesellschaft der Helaba Landesbank Hessen-Thüringen gegründet. Mit einem verwalteten Volumen von fast € 160 Mrd. inkl. Direktanlagen zählt die Helaba Invest im deutschen Markt zu den führenden Kapitalverwaltungsgesellschaften im institutionellen Asset Management.