



Finanzmathematik und -statistik I

Statistische Grundlagen und Kapitalmarkttheorie - Anwendungen bei Derivaten

Termin & Ort

7.-8. Februar 2011, 8.45 bis 17.30 Uhr
DVFA Center, Mainzer Landstraße 37-39, Frankfurt am Main

Ziele

Teilnehmer des Seminars erhalten einen Überblick über die wesentlichen mathematischen und statistischen Grundlagen, die zum Verständnis der am Kapitalmarkt verwendeten Begriffe und Methoden notwendig sind. Insbesondere werden die Interpretation und Bedeutung von finanzmathematischen und statistischen Kennziffern für Anlageentscheidungen herausgestellt. Am zweiten Tag werden Anwendungen für Derivate mit anschaulichen, praktischen Beispielen erläutert.

Agenda

Statistische Grundlagen

- Mittelwert und Standardabweichung
- Rendite bei Aktien-Return
- Risiko bei Aktien-Volatilität

Aktien-Indices

- Auswahl und Gewichtung der Aktien
- Berechnungsmethoden
- DAX und Stoxx

Barwert von Zahlungsströmen

- Renditen bei Anleihen / Zahlungsströmen
- Dividend-Discount-Modell

Kapitalmarkttheorie

- Rendite und Risiko als Basis für Anlageentscheidungen
- Korrelation und Beta
- Rendite und Risiko im Zwei- und Mehr-Aktien-Fall
- Single-Index-Modell

Funktionen und Ableitungen

Optionen

- Unter- und Obergrenzen
- Put-Call-Parität
- Binomial-Modell
- Black-Scholes-Modell
- Der Smile-Effekt

Unbedingte Terminkontrakte

- Forwards
- Futures

Referent

Christian Fotescu
Direktor Equity Derivatives Trading, HSBC Trinkaus & Burkhardt AG

Teilnahmegebühr

EUR 1.450 zzgl. MwSt.
EUR 1.160 zzgl. MwSt. für Teilnehmer der DVFA-Postgraduierten-Programme

Kontakt:

Tel: +49 (0)69 - 26 48 48 - 121
Mail:christiane.bauder@dvfa.de



Deutsche Vereinigung für Finanzanalyse und Asset Management



Anmeldeformular

Basis-Seminare 2011

Unter Anerkennung der Teilnahmebedingungen meldet unser Unternehmen / melde ich mich auf eigene Rechnung verbindlich für nebenstehend ausgewählte(s) Seminar(e) an:

Name _____

Vorname _____

Firma _____

Tätigkeit/Position _____

Anschrift _____

PLZ, Ort _____

Telefon _____

Fax _____

eMail _____

Ort/Datum _____ Stempel/Unterschrift _____

Basis-Seminar Termin	Teilnahmegebühr (in EUR zzgl. MwSt.)
<input type="checkbox"/> Bilanzierungsmethoden 20. Januar 2011	725,-
<input type="checkbox"/> Bilanzanalyse 21. Januar 2011	725,-
<input type="checkbox"/> Finanzmathematik und -statistik I (2 Tage) Statistische Grundlagen und Kapitalmarkttheorie 7.-8. Februar 2011	1.450,-
<input type="checkbox"/> Derivative und Strukturierte Finanzprodukte 9. Februar 2011	725,-
<input type="checkbox"/> Finanzmathematik und -statistik II Analyse und Prognose von Finanzmarktdaten 16. Februar 2011	725,-
<input type="checkbox"/> Analyse von Zinsinstrumenten 17. Februar 2011	725,-
<input type="checkbox"/> Aktienanalyse 18. Februar 2011	725,-
<hr/>	
<input type="checkbox"/> Bei Buchung von zwei oder mehr Seminaren pro Seminartag	649,- <i>Discount: 10%</i>
<input type="checkbox"/> Komplett-Paket ‚Basis-Seminare‘ Januar/Februar	4.640,- <i>Discount: 20%</i>

Seminarort:

DVFA Center, Mainzer Landstr. 37-39, 60329 Frankfurt

Teilnahmebedingungen:

Es gelten die Allgemeinen Teilnahmebedingungen der DVFA unter www.dvfa.de/teilnahmebedingungen, erhältlich auch gerne auf Anfrage unter Telefon (069) 26 48 48 - 121.

So melden Sie sich an:

Per Fax: (069) 26 48 48 - 488

Per Post: DVFA GmbH, Mainzer Landstraße 47a, 60329 Frankfurt

