



## Finanzmathematik und -statistik I \_

### Statistische Grundlagen und Kapitalmarkttheorie - Anwendungen bei Derivaten

#### Termin & Ort

**3.-4. August 2010, 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 2010

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"/> <b>Analyse von Zinsinstrumenten</b> 22. Juli 2010	725,-
<input type="checkbox"/> <b>Aktienanalyse</b> 23. Juli 2010	725,-
<input type="checkbox"/> <b>Finanzmathematik und -statistik I (2 Tage)</b> Statistische Grundlagen und Kapitalmarkttheorie 3.-4. August 2010	1.450,-
<input type="checkbox"/> <b>Derivative und Strukturierte Finanzprodukte</b> 5. August 2010	725,-
<input type="checkbox"/> <b>Finanzmathematik und -statistik II</b> Analyse und Prognose von Finanzmarktdaten 25. August 2010	725,-
<input type="checkbox"/> <b>Bilanzierungsmethoden</b> 26. August 2010	725,-
<input type="checkbox"/> <b>Bilanzanalyse</b> 27. August 2010	725,-
<hr/>	
<input type="checkbox"/> <b>Bei Buchung von zwei oder mehr Seminaren</b> pro Seminartag	649,-
<input type="checkbox"/> <b>Komplett-Paket ‚Basis-Seminare‘</b> Juli/August	4.640,-

#### Seminarort:

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

#### Teilnahmebedingungen:

Es gelten die Allgemeinen Teilnahmebedingungen der DVFA unter [www.dvfa.de/teilnahmebedingungen](http://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

