



Finanzmathematik und -statistik II

Analyse und Prognose von Finanzmarktdaten

Termin & Ort

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

Ziele

Teilnehmer des Seminars erhalten zunächst einen Überblick über die wesentlichen Eigenschaften von Finanzmarktzeitreihen. Die Zeitreihenverteilungen von Aktienrenditen oder von Zinsen weisen oft Besonderheiten auf, wie beispielsweise sogenannte „fat tails“ oder auch bestimmte Volatilitätscluster. Darauf aufbauend werden Hypothesentests dargestellt. Im zweiten Teil werden verschiedene Zeitreihen wie Portfoliorenditen und Marktrenditen mit Regressionsverfahren analysiert und prognostiziert. Das Seminar beinhaltet ausführliche praktische Übungen und ist durchgängig anwendungsorientiert mit vielen Beispielen aus der Kapitalmarktpraxis.

Agenda

Beschreibung von Finanzmarktzeitreihen

- Lage und Streuungsmaße
- Messung bivariater Zusammenhänge
- Korrelation und lineare Regression

Grundlage des Statistischen Testens

- Der Hypothesentest: Allgemeines Prinzip
- Der Mittelwert-t-Test
- Der t-Test im linearen Regressionsmodell
- Konfidenzintervall für den Erwartungswert
- Mittelwertvergleich

Zeitreihenanalyse

- ARMA-Modelle
- Volatilitätsmodelle

Regressionsanalyse

- Methodik (Wiederholung)
- Modelldiagnose
- CAPM-Schätzungen
- Bemerkungen zur Höhe des t-Wertes

Referent

Prof. Dr. Horst Entorf
Johann Wolfgang Goethe-Universität Frankfurt

Teilnahmegebühr

EUR 725 zzgl. MwSt.
EUR 580 zzgl. MwSt. für Teilnehmer der DVFA-Postgraduiertenprogramme

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

