

Vorstellung und Anwendung grundlegender mathematischer und statistischer Methoden im Risikomanagement und Controlling

Zielgruppe:

Mitarbeiter aus den Bereichen Handel, Markt, Marktfolge, Marktpreis-, Liquiditäts- sowie Kredit-Risikocontrolling und Revision.
(Advanced Level)

Lernziele:

Ausgehend von den statistischen Grundlagen (Häufigkeitsverteilungen, Lage-, Streuungs- und Korrelationsparameter) werden deren Anwendungsmöglichkeiten in der modernen Finanzanalyse vermittelt. Weiterhin behandelt das Seminar die Bedeutung der Wahrscheinlichkeitsrechnung in der Risikomessung und beim Backtesting und stellt die Grundzüge der Optionsbewertung vor. Einen weiteren Schwerpunkt bilden Methoden der Zinsrechnung und der Generierung von Ausfallwahrscheinlichkeiten, die für die Bewertung risikobehafteter Finanzinstrumente unabdingbar sind. Die Präsentation wichtiger Elemente der Differenzial-, Integral- und Matrizenrechnung und ihre Anwendungsmöglichkeiten in der Risikomanagement-Praxis runden das Seminar ab.

Inhalte:

- Grundlagen der Statistik: Häufigkeitsverteilungen, Lage- und Streuungsparameter, Betafaktor und Korrelation
- Wahrscheinlichkeitsrechnung: Binomialverteilung und Normalverteilung als Anwendungsbeispiele für diskrete und stetige Wahrscheinlichkeitsverteilungen
- Anwendungen der Wahrscheinlichkeitsrechnung
- Grundlagen der Zinsrechnung
- Verfahren zur Bewertung von Optionen
- Grundlagen der Funktionentheorie
- Polynome, Exponential- und Logarithmusfunktion
- Differenzialrechnung, Integralrechnung, Matrizenrechnung
- Rechnen mit Ausfallwahrscheinlichkeiten
- Pricing von Junk Bonds und Kreditderivaten
- Kalkulation von CDS-Prämien und fairen Kreditmargen

Methodik:

Interaktiver Fachvortrag, Diskussion, praktische Übungen

1	Termin: 06.06. (10:00 Uhr) – 09.06.2017 (17:00 Uhr)	Seminar-Nr.: OKR90_14 1712
	Ort: Frankfurt am Main	Preis, Dauer: 2.400,00 Euro für 4 Tage
2	Termin: 17.10. (10:00 Uhr) – 20.10.2017 (17:00 Uhr)	Seminar-Nr.: OKR90_14 1721
	Ort: Frankfurt am Main	Preis, Dauer: 2.400,00 Euro für 4 Tage

Das Seminar ist auch Modul von: „**Risikomanager für mittelständische Kreditinstitute**“

Preisvorteil von 10% ab dem 2. Teilnehmer pro Unternehmen und Seminartermin.

Unser gesamtes Angebot ist auch maßgeschneidert für Ihr Unternehmen buchbar. Gerne erstellen wir Ihnen ein individuelles Angebot.

Fachfragen: Christian Schätzlein, Tel. 069 154008-156, c.schaetzlein@fs.de

Organisation: Denise Shahid, Tel. 069 154008-238, d.shahid@fs.de