

Grundlagen der Finanzmathematik und Statistik

Zielgruppe

Mitarbeiter/-innen aus ALM und Treasury, (Risiko-)Controlling und Kalkulation, Revision, Prüfungsgesellschaften und Verbänden sowie Rechenzentralen

Ihr Nutzen

Das Seminar vermittelt die Grundlagen der Messung und Steuerung von Risiken im Kreditgewerbe (Einstieg in die Welt der Risiken und Chancen). Auch geeignet, um bereits vorhandenes Wissen aufzufrischen.

Seminarinhalt

Der Fokus liegt auf der Bereitstellung des methodischen Basiswissens aus den Bereichen Vor- und Nachkalkulation, Controlling und Steuerung verschiedener Risiken. Prüfungsrelevante Aspekte runden die Themen ab.

- Zinsrechnung – einfache Verzinsung und Zinseszinsrechnung an Praxisbeispielen
- Cashflow-Ermittlung und Effektivzinsberechnung
- Barwertberechnung
- Value-at-Risk und Expected Shortfall
- Statistik – Grundlagen
- Lineare Regression

Referenten



Markus Hausmann ist Mathematiker und bei msgGillardon als Berater im Bereich Kalkulations- und Ertragsmanagement und Referent von Seminaren und softwarebezogenen Schulungen (MARZIPAN) tätig. Seine Themen sind die Vor- und Nachkalkulation, implizite Optionen und Themengebiete aus der Zinsbuchsteuerung und dem Liquiditätsmanagement.



Dr. Sven Heumann ist promovierter Mathematiker und bei msgGillardon in der fachlichen Weiterentwicklung der Software, in der Fachberatung und als Referent tätig. Seine Schwerpunktthemen sind Marktpreisrisikosteuerung, Liquiditätsrisikosteuerung und Gesamtbankplanung – mit Fokus auf einen kennzahlenorientierten Ansatz – sowie Kapitalplanungsprozess und Liquiditätskostenverrechnungssystem.