

fineo.BANKADEMY

Statistik

Kursangebot für Unternehmen



Aufbaukurs



starker Themenfokus



Präsenzkurs



deutschsprachiger Kurs



Im Statistik-Seminar werden diejenigen statistischen Methoden eingeführt, die in der Finanzwirtschaft zur Anwendung kommen und die von den Teilnehmern in der täglichen Praxis benötigt werden, um statistische Größen wie Volatilität, Korrelation oder Beta zu interpretieren.

Kursübersicht Statistik

- Einführung und Lagemasse
- Streuungsmasse
- Zusammenhangsmasse
- Regressionsanalyse Einführung
- Regressionsanalyse Interpretation
- Integration und Anwendung

Der Inhousekurs Statistik richtet sich an alle Mitarbeiter aus Banken oder banknahen Institutionen (Fondsgesellschaften, IT-Dienstleister, Vermögensverwalter, etc.), die die alltäglichen statistischen Größen (z.B. Korrelationen, Volatilitäten, Beta) verstehen und interpretieren möchten.

Sowohl der Kurs selber, als auch die eingesetzten, etablierten Handouts und Lernmaterialien sind bereits mehrfach erprobt und immer wieder mit sehr positiven Feedbacks unserer Kunden bedacht worden.

Der Kurs besteht aus sechs 3-stündigen Sessions, die im Wochenrhythmus stattfinden. Die Länge und die Pause zwischen den Sessions sind so gewählt, dass den Teilnehmern zwischen den Sessions genügend Zeit bleibt, um die behandelten Themen zu repetieren und mit Übungen zu vertiefen. Andererseits ist es so auch möglich, die Sessions jeweils am Frühabend durchzuführen.

Eigenbeitrag der Teilnehmer

Die sechs Sessions reichen aus, um die grundlegenden Konzepte einzuführen und sie auch durch einige Beispiele zu illustrieren. Es ist jedoch unabdingbar, dass sich die Teilnehmer von Session zu Session mit dem Stoff auseinandersetzen. Hierfür werden den Teilnehmern jeweils am Ende einer Session eine Ausgabenserie abgegeben, die bis zum nächsten Termin zu lösen ist. Diese Serien werden jeweils zu Beginn der nächsten Session besprochen.

Prüfung

Der Kurs kann durch einen Test als Selbst- oder Lernkontrolle abgeschlossen werden.

1. Session:

Einführung und Lagemasse

- **Einführung**

Darstellung der grundlegenden Aufgabenstellung der Statistik mit Beispielen aus der Finanzwirtschaft.

- **Darstellungsarten**

Besprechung von unterschiedlichen Darstellungsarten von risikobehafteten Grössen, insbesondere Charts, Häufigkeits- und Zeitdiagramme.

- **Mittelwert**

Einführung des ersten statistischen Masses – des Mittelwerts. Beschreibung der Schätzung, Abgrenzung zu Durchschnittsrenditen und Illustration durch Beispiele.

2. Session:

Streuungs- masse

- **Einführung**

Einführung des Problems, die Streuung in stochastischen Grössen zu messen und darzustellen.

- **Varianz**

Einführung der Varianz als grundlegendes Streuungsmass. Intuitive Herleitung und anschliessende Beschreibung der Schätzung und damit verbundenen Problemen sowie Illustration durch Beispiele.

- **Volatilität**

Diskussion des von der Varianz abgeleiteten Volatilitätsmasses und die entsprechende Interpretation dieser Grösse auf der Basis von konkreten Beispielen aus der Finanzwirtschaft.

3. Session:

Zusammenhangsmasse

- **Einführung**

Motivation des Messens von Zusammenhängen.

- **Kovarianz**

Einführung der Kovarianz als Mass des Zusammenhangs und Beschreibung der Schätzung.

- **Korrelationskoeffizient**

Herleitung dieses standardisierten Masses und Interpretation von möglichen Werten. Illustration durch reale Beispiele.

4. Session: Regressionsanalyse – Einführung

- **Einführung**

Erläuterung von Problemstellungen, die mit Hilfe der Regressionsanalyse gelöst werden können.

- **Modell**

Einführung des einfachen, linearen Modells mit den dazugehörigen Schätzern.

- **Schätzung**

Illustration durch reale Beispiele.

5. Session: Regressionsanalyse – Interpretation

- **Interpretation**

Interpretationen von Ergebnissen aus der einfachen linearen Regression.

- **Bestimmtheitsmass**

Einführung dieses Erklärungsmaßes zur Beurteilung einer Regression.

- **Signifikanz**

Besprechung des Begriffs der Signifikanz im Zusammenhang mit der Regressionsanalyse.

6. Session: Integration und Anwendung

- **Portfolioanalyse**

Umsetzung sämtlicher statistischer Grössen in Microsoft Excel im Rahmen einer Portfolioanalyse. Dabei geht es einerseits darum, die Methoden selber umsetzen zu können und andererseits die Interpretation der Ergebnisse zu vertiefen.

Teilnehmerzahl

Die optimale Teilnehmerzahl beträgt 6 bis 8 Personen, jedoch maximal 16 Personen.

Durchführungsort

Der Kurs findet entweder in den zentral gelegenen Seminarräumen der fineo AG in Zürich statt, in Räumlichkeiten des Kunden oder an einem externen Ort.

Hilfsmittel

Die Teilnehmer benötigen einen handelsüblichen Taschenrechner (mit folgenden Operationen als Mindestanforderung: Potenzen und Wurzeln).

Für die sechste Session ist zudem sicherzustellen, dass die Teilnehmer Zugriff auf einen PC oder ein Notebook haben, auf dem Microsoft Excel installiert ist.

Anpassungen

Die sechs Sessions können inhaltlich an die speziellen Bedürfnisse des Kunden angepasst werden.

Der Kurs kann in deutscher oder englischer Sprache angeboten werden.

Falls wir mit diesem Kursformat Ihr Interesse geweckt haben, kontaktieren Sie bitte das Team der fineo AG für ein unverbindliches Beratungsgespräch unter 043 50 10 550 oder per info@fineo.ch.



Schweizerisches Qualitätszertifikat für Weiterbildungsinstitutionen
Certificat suisse de qualité pour les institutions de formation continue
Certificato svizzero di qualità per istituzioni di formazione continua

fineo

Sonnenbergstrasse 36
CH-8032 Zürich
Tel. +41 43 50 10 550
Fax +41 43 50 10 560
info@fineo.ch
www.fineo.ch

Copyright 2010 fineo AG. Alle Rechte vorbehalten.

statistik_100906.indd

