University of St.Gallen

5,240: Capital Market Theory

Subject information

ECTS-Credits: 3

Attached courses

Timetable	Language	Lecturer
5,240,1.00 Kapitalmarkttheorie	**Deutsch**	**Ammann Manuel, Verhofen Michael**

Course information

Course prerequisites

Course content

Die Vorlesung soll den Studierenden eine fundierte Einführung in die moderne Kapitalmarkttheorie liefern. Die Veranstaltung richtet sich an Studierende mit Interesse an der modernen Kapitalmarkttheorie und praxisrelevanten analytischen und quantitativen Methoden.
Die Schwerpunkte der Vorlesung liegen in den Bereichen Fixed Income, moderne Portfoliotheorie sowie derivative Instrumente. Nach dem Besuch der Vorlesung werden die Studierenden die wichtigsten Konzepte der Kapitalmarkttheorie beherrschen und grundsätzliche Problemstellungen in diesem Bereich selbständig lösen können.

Course structure

1. Einführung und Finanzmathematik
2. Zinsen und Zinsstruktur
3. Bond- und Zinsinstrumente & Dividend Discount Model
4. Zinsrisiko
5. Zinsrisikomanagement + Übung 1
6. Portfoliotheorie
7. Capital Asset Pricing Model (CAPM)
8. Anwendungen des CAPM und Performancemessung
9. Übung 2
10. Optionen, Futures und andere Derivate
11. Anwendungen von Derivaten + Übung 3

Course literature

Die Vorlesungsunterlagen werden via StudyNet zur Verfügung gestellt.

Course additional information

Information about the Examination

Examination type

decentral - Written examination (100%, 90 mins.)

Examination aids

Closed Book

The following rules apply to all examinations irrespective of requirements and use:

- A simple pocket calculator is admissible (for the definition of simple pocket calculators incapable of communication, cf. general regulations concerning examination aids of 14 December 2010 and note the "Pocket calculators" fact sheet). Any other EDP and electronic means of communication such as notebooks, PDAs and mobile telephones, etc., are inadmissible.
- A bilingual dictionary (without handwritten notes) may be used if the examination questions and/or answers are not in the candidate’s native language. Electronic dictionaries are inadmissible.
- The procurement of these examination aids is exclusively the students’ responsibility.
- No other examination aids are admissible.

Question language: **German**
Answer language: **German**

Examination content

Prüfungsrelevant ist der in der Vorlesung und den Übungen behandelte Lehrstoff (inkl. abgegebenen Unterlagen)

Exam-relevant literature

Prüfungsrelevant ist der in der Vorlesung und den Übungen behandelte Lehrstoff (inkl. abgegebenen Unterlagen)

Attention please:

Wir machen Sie darauf aufmerksam, dass dieses Merkblatt verbindlich ist und vor anderen Informationen wie persönlichen Datenbanken der Dozenten/-innen, Angaben in den Vorlesungen etc. unbedingt den Vorrang hat.

25.04.2013 07:19
valid for Herbstsemester 2008
Version 3 on 17.06.2009