

Prof. Dr. H. Luschgy

## **Seminarankündigung für WS 2009/10**

### **Zinsstrukturmodelle (Math Finance)**

Zeit: Di 16 – 18

Es liegen eine Vielzahl konkurrierender Zinsstrukturmodelle zur Bewertung von Zinsderivaten vor. Diese Modelle sollen im Seminar analysiert werden.

Das Seminar basiert u.a. auf

Björk, T. (1996). Interest Theory. In: Financial Mathematics, 53-122 (ed. W.J. Runggaldier), Lecture Notes in Mathematics 1656. Springer.

Kenntnisse der stochastischen Analysis sind erforderlich.

Interessenten mögen sich bitte bei mir (oder Frau Karpa) melden. Eine Vorbesprechung findet am

Dienstag, 21.7.2009, 15.00 Uhr im E 10

statt.