

Prof. Dr. H. Luschgy

Seminarankündigung für WS 2011/12

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

Filipović, D. (2009). Term-Structure Models. Springer.

Kenntnisse der stochastischen Analysis sind erforderlich.

Eine Vorbesprechung findet am

Dienstag, 12.7.11, 15.00 ct Uhr im E 10

statt.