

Seminarankündigung für das WS 2010/11

Finanzmathematik

Inhalt:

Das Seminar soll die Inhalte der Vorlesung *Finanzmathematik* II des Sommersemesters 2010 vertiefen und ergänzen. Zu den Schwerpunkten des Seminars zählen:

- Zinsstrukturmodelle (z. B. Heath-Jarrow-Morton-Ansatz, LIBOR-Marktmodell)
- Bewertung von Zinsderivaten (z. B. Swaps, Swaptions, Forwards, Futures)
- Kreditsensitive Finanzprodukte (z. B. CDS, Basket Default Swaps, CDO)
- Modellierung und Bewertung von Kreditrisiken

Literatur:

- Bielecki, T. R., Rutkowski, M.: *Credit Risk: Modeling, Valuation and Hedging*, Springer, 2002.
- Branger, N., Schlag, C.: *Zinsderivate: Modelle und Bewertung*, Springer, 2004.
- Brigo, D., Mercurio, F.: *Interest Rate Models: Theory and Practice*, Springer, 2001.
- Embrechts, P., Frey, R., McNeil, A. J.: *Quantitative Risk Management*, Princeton University Press, 2005.
- Filipović, D.: *Term-Structure Models - A Graduate Course*, Springer, 2009.
- Hull, J.: *Options, Futures, and other Derivatives*, Prentice Hall International, 2009.
- Overhaus, M. et al.: *Equity Hybrid Derivatives*, Wiley Finance, 2007.

Zeit:

mittwochs, 18 – 20 Uhr

Vorkenntnisse:

Zum Verständnis des Seminars sind Vorkenntnisse im Gebiet der *Stochastischen Analysis*, etwa im Umfang der Vorlesung *Finanzmathematik* II, erforderlich.

Anmeldung:

Bei Interesse am Seminar sollte die Anmeldung bis zum 1. September 2010 per E-Mail an T. Knispel (knispel@stochastik.uni-hannover.de) erfolgen. Für weitere Fragen steht T. Knispel (Raum F 450) zur Verfügung.