

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Zinsmodelle
In englischer Sprache	Term-Structure Models

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	2	

Inhalt

Die Vorlesung ist eine Einführung in die Arbitrage-Theorie der Bondmärkte.

Zum Inhalt gehören: Arbitrage Theorie, Short Rate Modelle, Heath-Jarrow-Morton (HJM) Modelle, Forwards and Futures, Affine Prozesse und Modelle, LIBOR Modelle in diskreter und stetiger Zeit

Voraussetzungen	Grundvorlesungen (Analysis I+II, Teilmodul Masstheorie, Lineare Algebra und Analytische Geometrie I+II), Stochastik II Empfohlen aber nicht Voraussetzung: Stochastische Analysis, Finanzmathematik I+II
------------------------	---

Regelsemester	Ab 5. oder 6. Fachsemester
----------------------	----------------------------

Abschluss	Mündliche Prüfung
------------------	-------------------

Prüfungszulassungsvoraussetzung	Abschluss Modul I und II
--	--------------------------

Studienpunkte	4
----------------------	---

R = Reine Mathematik

A = Angewandte Mathematik