

MATHEMATISCHE METHODEN FÜR ZINS- UND KREDITDERIVATE

VON DER THEORIE ZUR KONSTRUKTION VON BEWERTUNGSMODELLEN

ZIELSETZUNG	SEMINARINHALTE	SEMINARINFORMATIONEN
<p>Die Seminarteilnehmer erhalten einen Überblick über die theoretischen Grundlagen und mathematischen Konzepte der arbitragefreien Bewertung von Zins- und Kreditderivaten und deren Anwendung bei der Konstruktion von Bewertungsmodellen. In diesem Zusammenhang werden auch strukturierte Produkte aus dem Bereich der Zins- und Kreditderivate und deren Wirkungsweise vorgestellt. Das Seminar richtet sich an Teilnehmer mit gutem mathematischen Basiswissen (Stochastik, Differenzial- und Integralrechnung) und guten Kenntnissen von derivativen Produkten, die die grundlegenden quantitativen Techniken der Derivatebewertung und deren Anwendung kennen lernen wollen. (Advanced Level)</p>	<ul style="list-style-type: none"> ☰ Grundlagen <ul style="list-style-type: none"> ● Zinsstruktur, Zerorates, Forwardsätze, Geldmarktsätze ● Bewertung von Swaps, OIS-Diskontierung ☰ Arbitragefreie Bewertung <ul style="list-style-type: none"> ● Modellierung von Kursen, Zufallsprozesse, Random Walk, Wiener-Prozess, Stochastische DGLs ● Fundamentalsatz der Bewertung, Numeraires ● Black76 Formel, Caps, Floors und Swaptions ● Das SABR-Modell ● CVA und FVA ☰ Zinsstrukturmodelle und Zinsderivate <ul style="list-style-type: none"> ● Strukturierte Zinsprodukte ● Zinsstrukturmodelle: Grundlagen, Short Rate Modelle ● Hull-White-Modell mit Anwendung ● Libor-Market-Modelle, Smiles, Convexity Adjustments ☰ Kreditderivate <ul style="list-style-type: none"> ● Bewertung von Credit Default Swaps ● Modellierung des Ausfallzeitpunkts ● Gauß-Copula-Modell ● Bewertung von synthetischen CDOs 	<p>KATEGORIE Produkte</p> <p>G A P R</p> <hr/> <p>SEMINARDAUER</p> <p>1 2 3 4 5</p> <hr/> <p>SEMINARNUMMER P_08</p>