

In dem Seminar wird die Berechnung von Zinsderivaten behandelt. Da es anders als bei den Derivaten für Aktien im Bereich der Zinskurvenmodelle kein Standardbasismodell gibt (etwa vergleichbar mit dem Black-Scholes-Modell) werden zunächst einige Zinskurvenmodelle eingeführt. Grundkenntnisse der zeitstetigen Finanzmathematik etwa im Umfang meiner Vorlesung im FS 2013 sollten vorhanden sein.

Als Literatur liegen folgende Bücher zugrunde:

Thomas Björk: Interest Rate Theory, in: Financial Mathematics, B. Biais, Th. Björk, J. Cvitanic, N. El Karoui, E. Jouini u. J.C. Rochet Editors, Lecture Notes in Mathematics 1656, Springer Verlag 1997

Th. Björk: Arbitrage Theory in Continuous Time, 3rd Edition, Oxford Univ. Press 2009

D. Lamberton u. B. Lapeyre: Introduction to Stochastic Calculus, 2nd edition, Taylor Francis 2008

St. Shreve: Stochastic Calculus for Finance II Continuous-Time Models, Springer Verlag 2004

Interessenten für Vorträge wenden sich bitte an

**H.-J. Bartels, Fakultät für Mathematik und Informatik,
Universität Mannheim Seminargebäude A5, 68131 Mannheim,
Gebäudeteil B Zimmer 126,
Tel.: 0621 / 1812450
e-mail: bartels@math.uni-mannheim.de**

Als Hörsaal habe ich erst einmal den Raum C013 für die Zeit: Dienstag 12.00 – 13.30 Uhr reservieren lassen, **Terminwünsche können aber eventuell noch berücksichtigt werden**, soweit das von den Stundenplänen und Hörsälen her möglich ist.

Eine kurze

Vorbesprechung findet am **Dienstag, d. 3.9.2013** um **12.00 Uhr** im **Raum C013 im Gebäude A5** statt.

gez. H.-J. Bartels