

Announcement WiSe 2018/19

Lecture in Mathematical Finance

Credit Derivatives

Prof. Dr. Matthias Scherer

Gebiet: / Modulnr.: Finanzmathematik / MA 4711

Umfang: Vorlesung: 2 h Übung: 1h

Inhalt: Finanzmathematische Bewertung von Anleihen und Kreditderivaten in verschiedenen Kreditrisikomodellen (Einzelfirmen- und Portfolio Modelle).

Fortsetzung im nächsten Semester : Nein

Hörerkreis: MSc Mathematical Finance and Actuarial Science

Voraussetzung: Stochastic Analysis, Continuous Time Finance

Literatur: T. Bielecki & M. Rutkowski (2002): Credit Risk: Modeling, Valuation, and Hedging
N. Bingham & R. Kiesel (2004): Risk Neutral Valuation: Pricing and Hedging of Financial Derivatives
P. Schönbucher (2003): Credit Derivatives Pricing Models

Schein: Mündliche oder schriftliche Prüfung, abhängig von Hörerzahl, 5 CP

Ort und Zeit: BC2 3.5.06, Hörsaal (8102.03.506) Dienstag 14:15 - 15:45 Uhr

Übungen: BC2 3.5.06, Hörsaal (8102.03.506) Dienstag 16:15 - 17:45 Uhr