



## **Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung**



**Download**



**Online Lesen**

[Click here](#) if your download doesn't start automatically

# Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung

*Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn*

**Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung** Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn

 [Download Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathe ...pdf](#)

 [Online lesen Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mat ...pdf](#)

## **Downloaden und kostenlos lesen Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn**

---

432 Seiten

Werbetext

Angewandte Mathematik zur Modellierung von Kreditrisiken Kurzbeschreibung

Ein einführendes Lehrbuch, dessen Adressaten Studierende und Praktiker sind. Die Autoren versuchen dabei, einen Mittelweg zu gehen zwischen Theorie und praktischer Anwendung von Kreditderivaten und Kreditrisikomodellen. Thematisch werden die für das tägliche Bankgeschäft relevanten Aspekte angesprochen. Studierende werden fundiert an ein hochaktuelles Anwendungsgebiet der Mathematik herangeführt. Für Praktiker bietet das Werk eine systematische Darstellung der methodischen Grundlagen ihrer täglichen Arbeit, z. B. in Bezug auf die Implementierung von Risikomesssystemen. Buchrückseite Ein einführendes mathematisches Lehrbuch in die moderne Modellierung von Kreditrisiken, das sich an Studierende und Praktiker richtet. Erstmals geschieht dies in der vorliegenden zweiten, überarbeiteten Auflage explizit vor dem Hintergrund der aktuellen Entwicklungen und Folgen der Finanzkrise in Lehrbuchform. Die Autoren gehen dazu einen Mittelweg zwischen – teils noch intensiv diskutierter – Theorie und praktischer Anwendung von Kreditderivaten und Kreditrisikomodellen. Für Praktiker bietet das Werk eine systematische Darstellung der methodischen Grundlagen ihrer täglichen Arbeit, z.B. in Bezug auf die Implementierung von Kreditrisikomesssystemen oder den Einsatz und die Quotierung von Credit Default Swaps (CDS) vor und nach dem Small Bang von 2009. Darüber hinaus finden Studierende und Praktiker aber auch eine erste Einführung in die Mehrkurvenbewertung von Zinsswaps oder den mathematischen Hintergrund von Bewertungsanpassungen wie z.B. Credit Valuation Adjustments (CVA).**Der Inhalt** Märkte und Produkte - Arbitrage-theorie - Portfoliomodelle - Bewertung von Kreditderivaten - Mathematischer Anhang: Grundlagen der stochastischen Analysis - Jump Diffusion Prozesse - Copulas**Die**

### **Zielgruppen**

Studierende der Finanz- und Wirtschaftsmathematik, Praktiker aus Banken und Sparkassen**Die Autoren** Prof. Dr. Marcus R.W. Martin lehrt Finanzmathematik und Stochastik an der Hochschule Darmstadt, an der er auch Fachkoordinator für Finanzmathematik des Competence Center Stochastics and Operations Research (CCSOR) ist. Zuvor war er als Leiter bankaufsichtlicher Prüfungen und Leiter des Fachbereichs für Risikomodelle und Ratingverfahren bei der Deutschen Bundesbank tätig. Er ist auch als Trainer und Berater in der Praxis tätig. Prof. Dr. Stefan Reitz ist nach seiner Tätigkeit bei der Deutschen Bundesbank im Bereich der Bankenaufsicht Professor für Wirtschafts- und Finanzmathematik an der Hochschule für Technik in Stuttgart und außerdem als Trainer und Berater in bankaufsichtlichen Fragen tätig.

Dr. Carsten S. Wehn leitet bei der DekaBank die Einheit Risikomodelle, wo er u.a. die methodische Weiterentwicklung adäquater bankinterner Portfoliomodelle für Markt- und Kreditrisiken verantwortet. Zuvor war er bei der Deutschen Bundesbank für die Leitung und Durchführung bankaufsichtsrechtlicher Prüfungen quantitativer Risikomodelle zuständig. Er hält seit einigen Jahren im Rahmen eines Lehrauftrags Vorlesungen in Finanzmathematik.

Download and Read Online Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn #361CU2JME8P

Lesen Sie Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn für online ebook Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn Kostenlose PDF d0wnl0ad, Hörbücher, Bücher zu lesen, gute Bücher zu lesen, billige Bücher, gute Bücher, Online-Bücher, Bücher online, Buchbesprechungen epub, Bücher lesen online, Bücher online zu lesen, Online-Bibliothek, greatbooks zu lesen, PDF Beste Bücher zu lesen, Top-Bücher zu lesen Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn Bücher online zu lesen. Online Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn ebook PDF herunterladen Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn Doc Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn Mobipocket Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung von Marcus Martin, Stefan Reitz, Carsten Wehn EPub