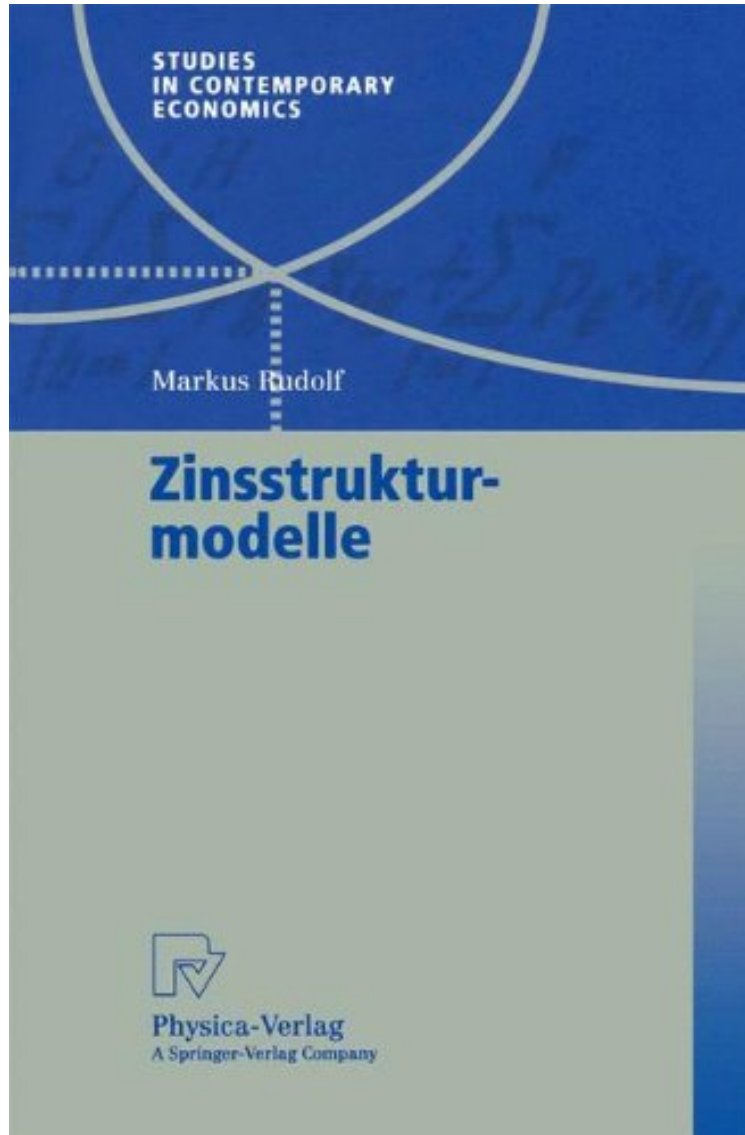


[Download pdf ebook] Zinsstrukturmodelle (Studies in Contemporary Economics)

## Zinsstrukturmodelle (Studies in Contemporary Economics)

Von Markus Rudolf

ePub | \*DOC | audiobook | ebooks | Download PDF



DOWNLOAD



+

READ ONLINE

Produktinformation -Verkaufsrank: #1001768 in BcherVerffentlicht am: 2000-02-17Erscheinungsdatum: 2013-10-04Abmessungen: 9.25 x .58b x 6.10l, .81 Pfund Einband: Taschenbuch242 Seiten | File size: 66.Mb

**Von Markus Rudolf : Zinsstrukturmodelle (Studies in Contemporary Economics)** before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Zinsstrukturmodelle (Studies in Contemporary Economics):

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen1 von 2 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Cool StuffVon Ein KundeDas Buch von Markus Rudolf ist ein idealer Einstieg in die Welt der Zinsstrukturmodelle: Es stellt zum einen die wichtigsten Ergebnisse in stetiger Zeit in einer bersichtlichen Form dar, um dann zum anderen

explizit auf die Implementation von Algorithmen zur Bewertung von Zinsderivaten einzugehen. Dabei verzichtet er auf rigorose Mathematik, auf die in vergleichbaren Werken so großer Wert gelegt wird. Es ist damit eine absolute Pflichtlektüre für Praktiker oder Studenten des Hauptstudiums.

**Kurzbeschreibung** Zinsstrukturmodelle sind Modellansätze, die eine konsequente Fortführung der Optionspreistheorie von Black und Scholes darstellen. Sie greifen die Problematik der Bewertung und des Risikomanagements von Zinsinstrumenten/Zinsderivaten auf. Dieses Buch unterscheidet sich von der bisherigen Literatur durch eine konsequente Aufarbeitung der Implementation von Zinsstrukturmodellen in zeitdiskreten Modellen. Ein besonderer Schwerpunkt liegt dabei auf den Ein- und Zweifaktormodellen von Ho und Lee, Hull und White sowie Heath, Jarrow, Morton. Eine Besonderheit besteht in der theoretischen und empirischen Analyse von Bond-Futures Kontrakten am deutschen Kapitalmarkt.