



Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition)

By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn

Download now

Read Online ➔

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn

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.

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

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

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition)

By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn

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.

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn Bibliography

- Sales Rank: #18668427 in Books
- Published on: 2014-05-12
- Original language: German
- Number of items: 1
- Dimensions: 9.49" h x .79" w x 6.61" l, .0 pounds
- Binding: Paperback
- 432 pages

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

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

Editorial Review

From the Back Cover

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.

About the Author

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.

Users Review

From reader reviews:

Margaret Clayton:

The book Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) make you feel enjoy for your spare time. You can utilize to make your capable far more increase. Book can being your best friend when you getting tension or having big problem using your subject. If you can make looking at a book Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) to be your habit, you can get more advantages, like add your capable, increase your knowledge about a few or all subjects. You could know everything if you like open and read a reserve Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition). Kinds of book are a lot of. It means that, science guide or encyclopedia or other people. So , how do you think about this publication?

Robert Russell:

In this 21st one hundred year, people become competitive in every way. By being competitive today, people have do something to make these survives, being in the middle of often the crowded place and notice by simply surrounding. One thing that oftentimes many people have underestimated this for a while is reading. Yep, by reading a book your ability to survive boost then having chance to endure than other is high. For you who want to start reading the book, we give you this Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) book as nice and daily reading e-book. Why, because this book is greater than just a book.

Michael Yancey:

The guide untitled Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) is the publication that recommended to you to read. You can see the quality of the e-book content that will be shown to you actually. The language that article author use to explained their ideas are easily to understand. The copy writer was did a lot of study when write the book, so the information that they share to your account is absolutely accurate. You also will get the e-book of Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) from the publisher to make you a lot more enjoy free time.

Arlene Miller:

Is it an individual who having spare time in that case spend it whole day by simply watching television programs or just telling lies on the bed? Do you need something new? This Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) can be the answer, oh how comes? A book you know. You are therefore out of date, spending your free time by reading in this brand-new era is common not a geek activity. So what these books have than the others?

Download and Read Online Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn #KOHL97V64FG

Read Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn for online ebook

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn Free PDF d0wnl0ad, audio books, books to read, good books to read, cheap books, good books, online books, books online, book reviews epub, read books online, books to read online, online library, greatbooks to read, PDF best books to read, top books to read Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn books to read online.

Online Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn ebook PDF download

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn Doc

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn Mobipocket

Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn EPub

KOHL97V64FG: Kreditderivate und Kreditrisikomodelle: Eine mathematische Einführung (German Edition) By Marcus R.W. Martin, Stefan Reitz, Carsten S. Wehn