

[www.mathfred.de](http://www.mathfred.de), <http://home.htw-berlin.de/~jaegera/lehre.html>  
[www.htw-berlin.de/hochschule/personen/person/?typo3state=persons&lsfid=8754](http://www.htw-berlin.de/hochschule/personen/person/?typo3state=persons&lsfid=8754)

## Themen

- Kassa- und Terminzinssätze, Nullkuponanleihen, Kuponanleihen, FRA, Forwardraten, Zinsfutures, Zinsswaps, Zinsoptionen, Zinsfloors, Zinscaps, ...
- Statistische Analyse von Zinsen, Hauptkomponentenanalyse, Schätzung der Zinsstruktur
- Risikomanagement festverzinslicher Wertpapiere
- Realzinsen, Nominalzinsen, Inflation, Geldpolitik
- Theorie und Empirie der Zinsstruktur
- Zeitdiskrete Zinsmodelle (Baummodelle), Zeitstetige Zinsmodelle, Derivatebewertung

Unterrichtsmaterialien (Formelsammlung und Aufgaben mit Lösungen) und Prüfungsbedingungen (Prüfungsform ist eine Klausur) publiziere ich auf der Moodle-Seite. Die hauptsächliche Quelle ist das Buch von Veronesi.

## Literatur

- Stephen **Blyth**: An Introduction to Quantitative Finance, Oxford University Press
- Steven **Shreve**: Stochastic Calculus for Finance II, Springer
- Bruce **Tuckman**: Fixed Income Securities, Wiley
- Pietro **Veronesi**: Fixed Income Securities, Wiley
- Lixin **Wu**: Interest Rate Modelling, Chapman & Hall/CRC

## Quellen im Netz

- Bondboard <https://www.bondboard.de/main>
- Finanzagentur <https://www.deutsche-finanzagentur.de/anleihen-einmaleins/> und <https://www.deutsche-finanzagentur.de/de/private-anleger/wissen-verstehen/> und <https://www.deutsche-finanzagentur.de/de/institutionelle-investoren/> und <https://www.deutsche-finanzagentur.de/de/institutionelle-investoren/>
- <https://www.bundesbank.de/de/statistiken/geld-und-kapitalmaerkte/zinssaetze-und-renditen/zinsstruktur-am-rentenmarkt> und <https://www.bundesbank.de/de/statistiken/geld-und-kapitalmaerkte/zinssaetze-und-renditen/kurse-renditen-der-bundeswertpapiere>
- <https://www.theice.com/products/38527986/Three-Month-Euribor-Futures>
- <https://deutsche-boerse.com/exchange-en/products/int/mon/euribor>

<https://www.wsj.com/market-data/bonds/treasuries>  
<https://www.bondboard.de/main>  
[https://www.bundesbank.de/dynamic/action/de/statistiken/zeitreihen-datenbanken/zeitreihen-datenbank/759778/759778?listId=www\\_skms\\_it06a&treeAnchor=GELD](https://www.bundesbank.de/dynamic/action/de/statistiken/zeitreihen-datenbanken/zeitreihen-datenbank/759778/759778?listId=www_skms_it06a&treeAnchor=GELD)  
<https://www.deutsche-finanzagentur.de/de/>  
<https://www.wsj.com/market-data/bonds/treasuries>

Quellen berücksichtigen :  
*Sundaresan: Fixed Income*