



Optionen, Futures und andere Derivate

Das Übungsbuch

10., aktualisierte Auflage

John C. Hull

Optionen, Futures und andere Derivate

Das Übungsbuch

10., aktualisierte Auflage

John C. Hull

Übersetzung durch
Dr. Wolfgang Mader und Dr. Marc Wagner

Optionen, Futures und andere Derivate - Das Übungsbuch

Inhaltsverzeichnis

Optionen, Futures und andere Derivate - Das Übungsbuch

Inhaltsverzeichnis

Vorwort

Kapitel 1 Einführung

Praktische Fragestellungen

Kapitel 2 Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien

Praktische Fragestellungen

Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures

Praktische Fragestellungen

Kapitel 4 Zinssätze

Praktische Fragestellungen

Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 6 Zins-Futures

Praktische Fragestellungen

Kapitel 7 Swaps

Praktische Fragestellungen

Kapitel 8 Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007

Praktische Fragestellungen

Kapitel 9 XVAs

Praktische Fragestellungen

Kapitel 10 Optionsmärkte

Praktische Fragestellungen

Kapitel 11 Eigenschaften von Aktienoptionen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 12 Handelsstrategien mit Optionen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 13 Binomialbäume

Praktische Fragestellungen

Kapitel 14 Wiener-Prozesse und Itô's Lemma

Praktische Fragestellungen

Kapitel 15 Das Black-Scholes-Merton-Modell

Praktische Fragestellungen

Inhaltsverzeichnis

Kapitel 16 Mitarbeiteroptionen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 17 Optionen auf Aktienindizes und Währungen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 18 Optionen auf Futures und das Black-Modell

Praktische Fragestellungen

Kapitel 19 Sensitivitäten von Optionspreisen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 20 Volatility Smiles

Praktische Fragestellungen

Kapitel 21 Numerische Verfahren: Grundlagen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 22 Value at Risk

Praktische Fragestellungen

Kapitel 23 Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 24 Kreditrisiko

Praktische Fragestellungen

Kapitel 25 Kreditderivate

Praktische Fragestellungen

Kapitel 26 Exotische Optionen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 27 Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung

Praktische Fragestellungen

Kapitel 28 Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße

Praktische Fragestellungen

Kapitel 29 Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle

Praktische Fragestellungen

Kapitel 30 Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos

Praktische Fragestellungen

Kapitel 31 Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate

Praktische Fragestellungen

Kapitel 32 No-Arbitrage-Modelle der Short Rate

Praktische Fragestellungen

Kapitel 33 Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven

Inhaltsverzeichnis

Praktische Fragestellungen

Kapitel 34 Mehr zu Swaps

Praktische Fragestellungen

Kapitel 35 Energie- und Rohstoffderivate

Praktische Fragestellungen

Kapitel 36 Realoptionen

Praktische Fragestellungen

Copyright

Copyright

Daten, Texte, Design und Grafiken dieses eBooks, sowie die eventuell angebotenen eBook-Zusatzdaten sind urheberrechtlich geschützt. Dieses eBook stellen wir lediglich als **persönliche Einzelplatz-Lizenz** zur Verfügung!

Jede andere Verwendung dieses eBooks oder zugehöriger Materialien und Informationen, einschließlich

- der Reproduktion,
- der Weitergabe,
- des Weitervertriebs,
- der Platzierung im Internet, in Intranets, in Extranets,
- der Veränderung,
- des Weiterverkaufs und
- der Veröffentlichung

bedarf der **schriftlichen Genehmigung** des Verlags. Insbesondere ist die Entfernung oder Änderung des vom Verlag vergebenen Passwort- und DRM-Schutzes ausdrücklich untersagt!

Bei Fragen zu diesem Thema wenden Sie sich bitte an: **info@pearson.de**

Zusatzdaten

Möglicherweise liegt dem gedruckten Buch eine CD-ROM mit Zusatzdaten oder ein Zugangscode zu einer eLearning Plattform bei. Die Zurverfügungstellung dieser Daten auf unseren Websites ist eine freiwillige Leistung des Verlags. **Der Rechtsweg ist ausgeschlossen.** Zugangscodes können Sie darüberhinaus auf unserer Website käuflich erwerben.

Hinweis

Dieses und viele weitere eBooks können Sie rund um die Uhr und legal auf unserer Website herunterladen:

<https://www.pearson-studium.de>