

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	7	
Kapitel 1	Einführung	9
Kapitel 2	Futures-Märkte	21
Kapitel 3	Absicherungsstrategien mit Futures	29
Kapitel 4	Zinssätze	37
Kapitel 5	Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	47
Kapitel 6	Zins-Futures	59
Kapitel 7	Swaps	69
Kapitel 8	Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007	81
Kapitel 9	Optionsmärkte	85
Kapitel 10	Eigenschaften von Aktienoptionen	95
Kapitel 11	Handelsstrategien mit Optionen	105
Kapitel 12	Binomialbäume	115
Kapitel 13	Wiener-Prozesse und Itôs Lemma	127
Kapitel 14	Das Black-Scholes-Merton-Modell	135
Kapitel 15	Mitarbeiteroptionen	151
Kapitel 16	Optionen auf Aktienindizes und Währungen	155
Kapitel 17	Optionen auf Futures	167
Kapitel 18	Sensitivitäten von Optionspreisen	177
Kapitel 19	Volatility Smiles	193
Kapitel 20	Numerische Verfahren: Grundlagen	203

Kapitel 21	Value at Risk	223
Kapitel 22	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	229
Kapitel 23	Kreditrisiko	237
Kapitel 24	Kreditderivate	249
Kapitel 25	Exotische Optionen	259
Kapitel 26	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	269
Kapitel 27	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	283
Kapitel 28	Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle	291
Kapitel 29	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	301
Kapitel 30	Zinsderivate: Die Short-Rate-Modelle	309
Kapitel 31	Zinsderivate: Das HJM- und das LIBOR-Market-Modell	323
Kapitel 32	Mehr zu Swaps	331
Kapitel 33	Energie- und Rohstoffderivate	335
Kapitel 34	Realoptionen	339