

# Inhaltsverzeichnis

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

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