

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	7
Bearbeitungshinweise	9
I Aufgaben und Fallstudien	13
1 Wertpapiere	15
2 Ertrag-Risiko-Profil	23
3 Portfolioanalyse	29
4 Das <i>Capital Asset Pricing Model</i> – CAPM	33
5 Black-Litterman	47
6 Risikobewertung	51
7 Derivate und Absicherungsstrategien	53
II Kommentierte Lösungen	59
8 Wertpapiere	61
9 Ertrag-Risiko-Profil	89
10 Portfolioanalyse	107
11 Das <i>Capital Asset Pricing Model</i> – CAPM	119
12 Black-Litterman	129
13 Risikobewertung	133
14 Derivate und Absicherungsstrategien	139
III Übungsklausuren	151
15 Klausur 1	153
15.1 Klausuraufgaben	154
15.2 Kommentierte Lösungen	164
16 Klausur 2	181
16.1 Klausuraufgaben	182
16.2 Kommentierte Lösungen	191

IV Formelsammlung	203
Anleihen	205
Diskontfaktor	205
Zerobond	205
Kuponanleihe	205
Duration	206
Zusammenhang der Durationen	206
Konvexität	206
Forward-Sätze	206
Statistik	207
Stichprobenmittelwert	207
Stichprobenvarianz	207
Stichprobenstandardabweichung	207
Stichprobenkovarianz	207
Stichprobenkorrelation	208
Portfoliotheorie	209
Grundgleichungen der Portfoliotheorie	209
Nebenbedingungsfunktion – Kapitalerhalt	209
Minimum-Varianz-Portfolio	210
CAPM	211
Sharpe-Quotient	211
Kapitalmarktlinie	211
Charakteristische Linie	211
Beta-Faktor	211
Wertpapierlinie	212
Jensen-Alpha	212
Derivate	213
Black-Scholes-Merton Differentialgleichung	213
Forward-Kontrakt	213
Option	214
Symbolverzeichnis	215
Literaturverzeichnis	217
Stichwortverzeichnis	219
Abbildungsverzeichnis	222
Tabellenverzeichnis	223