

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	7
Kapitel 1 Einführung	9
Kapitel 2 Futures-Märkte	23
Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures	31
Kapitel 4 Zinssätze	39
Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	49
Kapitel 6 Zins-Futures	61
Kapitel 7 Swaps	71
Kapitel 8 Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007	83
Kapitel 9 OIS-Diskontierung, Kreditaspekte und Finanzierungskosten	87
Kapitel 10 Optionsmärkte	91
Kapitel 11 Eigenschaften von Aktienoptionen	101
Kapitel 12 Handelsstrategien mit Optionen	111
Kapitel 13 Binomialbäume	121
Kapitel 14 Wiener-Prozesse und Itôs Lemma	135
Kapitel 15 Das Black-Scholes-Merton-Modell	143
Kapitel 16 Mitarbeiteroptionen	159
Kapitel 17 Optionen auf Aktienindizes und Währungen	163
Kapitel 18 Optionen auf Futures	175
Kapitel 19 Sensitivitäten von Optionspreisen	185
Kapitel 20 Volatility Smiles	201

Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	211
Kapitel 22	Value at Risk	231
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	237
Kapitel 24	Kreditrisiko	245
Kapitel 25	Kreditderivate	255
Kapitel 26	Exotische Optionen	265
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	275
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	289
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle	297
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	307
Kapitel 31	Zinsderivate: Die Short-Rate-Modelle	315
Kapitel 32	Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven	327
Kapitel 33	Mehr zu Swaps	335
Kapitel 34	Energie- und Rohstoffderivate	339
Kapitel 35	Realoptionen	345