

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	7
Kapitel 1 Einführung	9
Kapitel 2 Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien	27
Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures	39
Kapitel 4 Zinssätze	51
Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	65
Kapitel 6 Zins-Futures	81
Kapitel 7 Swaps	95
Kapitel 8 Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007	111
Kapitel 9 XVA	117
Kapitel 10 Optionsmärkte	121
Kapitel 11 Eigenschaften von Aktienoptionen	135
Kapitel 12 Handelsstrategien mit Optionen	149
Kapitel 13 Binomialbäume	163
Kapitel 14 Wiener-Prozesse und Itôs Lemma	183
Kapitel 15 Das Black-Scholes-Merton-Modell	195
Kapitel 16 Mitarbeiteroptionen	217
Kapitel 17 Optionen auf Aktienindizes und Währungen	225
Kapitel 18 Optionen auf Futures und das Black-Modell	241
Kapitel 19 Sensitivitäten von Optionspreisen	255

Kapitel 20	Volatility Smiles	275
Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	289
Kapitel 22	Value at Risk	315
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	325
Kapitel 24	Kreditrisiko	335
Kapitel 25	Kreditderivate	349
Kapitel 26	Exotische Optionen	363
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	381
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	401
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle	411
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	423
Kapitel 31	Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate	435
Kapitel 32	No-Arbitrage-Modelle der Short Rate	445
Kapitel 33	Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven	455
Kapitel 34	Mehr zu Swaps	463
Kapitel 35	Energie- und Rohstoffderivate	467
Kapitel 36	Realoptionen	473