

# Inhaltsverzeichnis

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

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