

Inhaltsverzeichnis

Geleitwort	IX
Vorwort des Herausgebers	X
Kapitel I: Grundlagen Derivativer Instrumente	1
<i>Roland Eller</i> Derivative Instrumente – Überblick, Strategien, Tendenzen	3
<i>Roland Eller</i> Risikomanagement von Zinsinstrumenten im Wandel der Zeit	39
<i>Roland Eller</i> Kurs- und Performanceindices am deutschen Rentenmarkt	73
<i>Friedrich Munsberg</i> Der Pfandbrief-Index PEX – Spiegel des deutschen Pfandbriefmarktes	93
<i>Dr. Hubert-Ralph Schmitt</i> Stripping strukturierter Anleihen	113
<i>Dr. Hans-Peter Deutsch</i> Risiko: Management von High-Tech Geschäften mit High-Tech Systemen	123
Kapitel II: Märkte für Derivate Instrumente	153
<i>Dr. Carl Heinz Daube</i> Risikomanagement für Aktienoptionen	155
<i>Heinz Hauser</i> Pricing und Risk-Management von Caps, Floors und Swap-Optionen	187
<i>Dr. Andreas Pechtl</i> Optionen mit speziellen Eigenschaften (Exotic Options)	225
<i>Hermann Collmann</i> Der Reverse Floater	261

Kapitel III:**Strategien mit Derivaten Instrumenten** 289*Andreas Sahl*

Integriertes Hedging von Risiken mit dem Portfolio-Ansatz 291

Stefan Dreesbach

Derivative Aktienindexprodukte im modernen Portfoliomanagement 301

Roland Eller

Strategien mit Financial Futures 339

Dr. Christoph Avenarius

Management von Währungsrisiken 375

Roland Eller

Zinsswaps – Produktbeschreibung, Pricing und Bewertung 401

Christian Spindler

Währungsmanagement in internationalen Unternehmen 419

Kapitel IV:**Management von Derivaten Instrumenten** 445*Roland Jauch / Jodok Müller*

Risikomanagement der Raiffeisenbank Kleinwalsertal AG 447

Lutz Krannich

Risiken der Wertpapierleihe und Wertpapierpensionsgeschäfte 487

Franz M. Dahl

Revision im Währungsmanagement 537

Jörg Birkelbach

Softwareüberblick Derivativer Instrumente 555

Ulrich Willeitner

Brady-Bonds – Ein neuer Markt nur für »Yield-hunter«? 587

Paul Hagen / Wolfgang Jakobs

Marktrisikosteuerung bei Trinkaus & Burkhardt 631

Kapitel V:**Bewertung, Bilanzierung und aufsichtsrechtliche Belange****Derivativer Instrumente** 647*Dr. Andreas Bertsch / Ralph Kärcher*

Derivative Instrumente im Jahresabschluß und in der Steuerbilanz 649

*Dr. Walter Gruber / Roland Raskopf*Die Behandlung von derivaten Zinsinstrumenten
in der Kapitaladäquanzrichtlinie 689

Glossar 717

Stichwortverzeichnis 753