

# Inhaltsverzeichnis

Vorwort	7
Kapitel 1 Einführung	9
Kapitel 2 Futures-Märkte	21
Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures	29
Kapitel 4 Zinssätze	37
Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	47
Kapitel 6 Zins-Futures	59
Kapitel 7 Swaps	69
Kapitel 8 Optionsmärkte	81
Kapitel 9 Eigenschaften von Aktienoptionen	91
Kapitel 10 Handelsstrategien mit Optionen	101
Kapitel 11 Binomialbäume	109
Kapitel 12 Wiener-Prozesse und Itô's Lemma	121
Kapitel 13 Das Black-Scholes-Merton-Modell	129
Kapitel 14 Mitarbeiteroptionen	145
Kapitel 15 Optionen auf Aktienindizes und Währungen	149
Kapitel 16 Optionen auf Futures	161
Kapitel 17 Sensitivitäten von Optionspreisen	171
Kapitel 18 Volatility Smiles	187
Kapitel 19 Numerische Verfahren: Grundlagen	197
Kapitel 20 Value at Risk	217

<b>Kapitel 21</b>	<b>Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen</b>	<b>225</b>
<b>Kapitel 22</b>	<b>Kreditrisiko</b>	<b>233</b>
<b>Kapitel 23</b>	<b>Kreditderivate</b>	<b>245</b>
<b>Kapitel 24</b>	<b>Exotische Optionen</b>	<b>255</b>
<b>Kapitel 25</b>	<b>Wetter-, Energie- und Versicherungsderivate</b>	<b>265</b>
<b>Kapitel 26</b>	<b>Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung</b>	<b>269</b>
<b>Kapitel 27</b>	<b>Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße</b>	<b>281</b>
<b>Kapitel 28</b>	<b>Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle</b>	<b>291</b>
<b>Kapitel 29</b>	<b>Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos</b>	<b>301</b>
<b>Kapitel 30</b>	<b>Zinsderivate: Die Short-Rate-Modelle</b>	<b>309</b>
<b>Kapitel 31</b>	<b>Zinsderivate: Das HJM- und das LIBOR-Market-Modell</b>	<b>321</b>
<b>Kapitel 32</b>	<b>Mehr zu Swaps</b>	<b>329</b>
<b>Kapitel 33</b>	<b>Realoptionen</b>	<b>333</b>