

Inhaltsverzeichnis

Vorwort		7
Kapitel 1	Einführung	9
Kapitel 2	Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien	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	XVAs	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 Itô's Lemma	135
Kapitel 15	Das Black-Scholes-Merton-Modell	143
Kapitel 16	Mitarbeiteroptionen	161
Kapitel 17	Optionen auf Aktienindizes und Währungen	165
Kapitel 18	Optionen auf Futures und das Black-Modell	177
Kapitel 19	Sensitivitäten von Optionspreisen	187
Kapitel 20	Volatility Smiles	203
Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	213

Kapitel 22	Value at Risk	233
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	241
Kapitel 24	Kreditrisiko	249
Kapitel 25	Kreditderivate	259
Kapitel 26	Exotische Optionen	269
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	279
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	293
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle	301
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	311
Kapitel 31	Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate	319
Kapitel 32	No-Arbitrage-Modelle der Short Rate	327
Kapitel 33	Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven	335
Kapitel 34	Mehr zu Swaps	343
Kapitel 35	Energie- und Rohstoffderivate	347
Kapitel 36	Realoptionen	353