

Optionen, Futures und andere Derivate

9., aktualisierte Auflage

John C. Hull

Fachliche Betreuung der deutschen Übersetzung
durch Dr. Wolfgang Mader und Dr. Marc Wagner

Inhaltsübersicht

Vorwort		19
Kapitel 1	Einführung	23
Kapitel 2	Futures-Märkte	51
Kapitel 3	Absicherungsstrategien mit Futures	81
Kapitel 4	Zinssätze	113
Kapitel 5	Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	145
Kapitel 6	Zins-Futures	179
Kapitel 7	Swaps	203
Kapitel 8	Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007	241
Kapitel 9	OIS-Diskontierung, Kreditaspekte und Finanzierungskosten	259
Kapitel 10	Optionsmärkte	275
Kapitel 11	Eigenschaften von Aktienoptionen	301
Kapitel 12	Handelsstrategien mit Optionen	325
Kapitel 13	Binomialbäume	349
Kapitel 14	Wiener-Prozesse und Itös Lemma	381
Kapitel 15	Das Black-Scholes-Merton-Modell	403
Kapitel 16	Mitarbeiteroptionen	443
Kapitel 17	Optionen auf Aktienindizes und Währungen	459
Kapitel 18	Optionen auf Futures	479
Kapitel 19	Sensitivitäten von Optionspreisen	499
Kapitel 20	Volatility Smiles	537
Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	559
Kapitel 22	Value at Risk	609
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	641
Kapitel 24	Kreditrisiko	667
Kapitel 25	Kreditderivate	699
Kapitel 26	Exotische Optionen	731
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	761
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	797
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Markt-Modelle	819
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	843
Kapitel 31	Zinsderivate: Die Short-Rate-Modelle	859
Kapitel 32	Das HJM-, das UBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven	899

Kapitel 33	Mehr zu Swaps	923
Kapitel 34	Energie- und Rohstoffderivate	943
Kapitel 35	Realoptionen	963
Kapitel 36	Große Verluste bei Derivatgeschäften und ihre Lehren	979
	Glossar der Fachbegriffe	995
	Die DerivaGem-Software	1021
	Die wichtigsten Börsen für Futures und Optionen	1027
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x < 0$	1029
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x > 0$	1031
	Register	1033