

Optionen, Futures und andere Derivate

10., 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 und zentrale Gegenparteien	51
Kapitel 3	Absicherungsstrategien mit Futures	81
Kapitel 4	Zinssätze	115
Kapitel 5	Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen	151
Kapitel 6	Zins-Futures	185
Kapitel 7	Swaps	209
Kapitel 8	Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007	243
Kapitel 9	XVAs	261
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 Itô's 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 und das Black-Modell	479
Kapitel 19	Sensitivitäten von Optionspreisen	499
Kapitel 20	Volatility Smiles	539
Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	561
Kapitel 22	Value at Risk	611
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	643
Kapitel 24	Kreditrisiko	669
Kapitel 25	Kreditderivate	701
Kapitel 26	Exotische Optionen	733
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	765
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	801
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Markt-Modelle	823
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	847
Kapitel 31	Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate	863
Kapitel 32	No-Arbitrage-Modelle der Short Rate	879
Kapitel 33	Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und mehrere Zinsstrukturkurven	907

Kapitel 34	Mehr zu Swaps	929
Kapitel 35	Energie- und Rohstoffderivate	949
Kapitel 36	Realoptionen	969
Kapitel 37	Große Verluste bei Derivatgeschäften und ihre Lehren	985
	Glossar der Fachbegriffe	1001
	Die DerivaGem-Software	1027
	Die wichtigsten Börsen für Futures und Optionen	1034
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x \leq 0$	1035
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x \geq 0$	1037
	Quellenangaben	1039
	Autorenverzeichnis	1041
	Register	1047