

Optionen, Futures und andere Derivate

11., aktualisierte Auflage

John C. Hull

Inhaltsübersicht

Vorwort		19
Kapitel 1	Einführung	25
Kapitel 2	Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien	53
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 2007/08	237
Kapitel 9	XVAs	255
Kapitel 10	Optionsmärkte	269
Kapitel 11	Eigenschaften von Aktienoptionen	293
Kapitel 12	Handelsstrategien mit Optionen	317
Kapitel 13	Binomialbäume	341
Kapitel 14	Wiener-Prozesse und Itô's Lemma	373
Kapitel 15	Das Black-Scholes-Merton-Modell	399
Kapitel 16	Mitarbeiteroptionen	439
Kapitel 17	Optionen auf Aktienindizes und Währungen	455
Kapitel 18	Optionen auf Futures und das Black-Modell	475
Kapitel 19	Sensitivitäten von Optionspreisen	495
Kapitel 20	Volatility Smiles	535
Kapitel 21	Numerische Verfahren: Grundlagen	557
Kapitel 22	Value at Risk	607
Kapitel 23	Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen	639
Kapitel 24	Kreditrisiko	663
Kapitel 25	Kreditderivate	693
Kapitel 26	Exotische Optionen	725
Kapitel 27	Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung	755
Kapitel 28	Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße	791
Kapitel 29	Zinsderivate: Die Standard-Markt-Modelle	813
Kapitel 30	Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos	837
Kapitel 31	Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate	851
Kapitel 32	No-Arbitrage-Modelle der Short Rate	867
Kapitel 33	Die Modellierung von Forward Rates	895
Kapitel 34	Mehr zu Swaps	915

Kapitel 35	Energie- und Rohstoffderivate	931
Kapitel 36	Realoptionen	951
Kapitel 37	Große Verluste bei Derivatgeschäften und ihre Lehren	967
	Glossar der Fachbegriffe	983
	Die DerivaGem-Software	1009
	Börsen für Futures und Optionen	1015
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x \leq 0$	1016
	Wertetabelle der Standardnormalverteilung $N(x)$ für $x \geq 0$	1017
	Autorenverzeichnis	1018
	Register	1023