



Optionen, Futures und andere Derivate

Das Übungsbuch

11., aktualisierte Auflage

John C. Hull



Pearson

Optionen, Futures und andere Derivate
Das Übungsbuch

Optionen, Futures und andere Derivate

- Übungsbuch

Inhaltsverzeichnis

Optionen, Futures und andere Derivate - Das
Übungsbuch

Inhaltsverzeichnis

Vorwort

Kapitel 1 Einführung

 Fragen

 Übungsaufgaben

Kapitel 2 Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien

 Fragen

 Übungsaufgaben

Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures

 Fragen

 Übungsaufgaben

Kapitel 4 Zinssätze

 Fragen

 Übungsaufgaben

Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen

 Fragen

 Übungsaufgaben

Kapitel 6 Zins-Futures

 Fragen

 Übungsaufgaben



Inhaltsverzeichnis

Kapitel 7 Swaps

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 8 Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 9 XVA

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 10 Optionsmärkte

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 11 Eigenschaften von Aktienoptionen

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 12 Handelsstrategien mit Optionen

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 13 Binomialbäume

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 14 Wiener-Prozesse und Itôs Lemma

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 15 Das Black-Scholes-Merton-Modell

Fragen

Übungsaufgaben



Inhaltsverzeichnis

Kapitel 16 Mitarbeiteroptionen

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 17 Optionen auf Aktienindizes und Währungen

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 18 Optionen auf Futures und das Black-Modell

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 19 Sensitivitäten von Optionspreisen

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 20 Volatility Smiles

Fragen

Übungsaufgaben

Kapitel 21 Numerische Verfahren: Grundlagen

Übungsaufgaben

Kapitel 22 Value at Risk

Übungsaufgaben

Kapitel 23 Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen

Übungsaufgaben

Kapitel 24 Kreditrisiko

Übungsaufgaben

Kapitel 25 Kreditderivate

Übungsaufgaben

Kapitel 26 Exotische Optionen

Übungsaufgaben



Inhaltsverzeichnis

Kapitel 27 Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung

Übungsaufgaben

Kapitel 28 Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße

Übungsaufgaben

Kapitel 29 Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle

Übungsaufgaben

Kapitel 30 Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine
und Quantos

Übungsaufgaben

Kapitel 31 Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate

Übungsaufgaben

Kapitel 32 No-Arbitrage-Modelle der Short Rate

Übungsaufgaben

Kapitel 33 Das HJM-, das LIBOR-Market-Modell und
mehrere Zinsstrukturkurven

Übungsaufgaben

Kapitel 34 Mehr zu Swaps

Übungsaufgaben

Kapitel 35 Energie- und Rohstoffderivate

Übungsaufgaben

Kapitel 36 Realoptionen

Übungsaufgaben

Copyright



Copyright

Daten, Texte, Design und Grafiken dieses eBooks, sowie die eventuell angebotenen eBook-Zusatzdaten sind urheberrechtlich geschützt. Dieses eBook stellen wir lediglich als **persönliche Einzelplatz-Lizenz** zur Verfügung!

Jede andere Verwendung dieses eBooks oder zugehöriger Materialien und Informationen, einschließlich

- der Reproduktion,
- der Weitergabe,
- des Weitervertriebs,
- der Platzierung im Internet, in Intranets, in Extranets,
- der Veränderung,
- des Weiterverkaufs und
- der Veröffentlichung

bedarf der **schriftlichen Genehmigung** des Verlags. Insbesondere ist die Entfernung oder Änderung des vom Verlag vergebenen Passwort- und DRM-Schutzes ausdrücklich untersagt!

Bei Fragen zu diesem Thema wenden Sie sich bitte an: **info@pearson.de**

Zusatzdaten

Möglicherweise liegt dem gedruckten Buch eine CD-ROM mit Zusatzdaten oder ein Zugangscode zu einer eLearning Plattform bei. Die Zurverfügungstellung dieser Daten auf unseren Websites ist eine freiwillige Leistung des Verlags. **Der Rechtsweg ist ausgeschlossen.** Zugangscodes können Sie darüberhinaus auf unserer Website käuflich erwerben.

Hinweis

Dieses und viele weitere eBooks können Sie rund um die Uhr und legal auf unserer Website herunterladen:

<https://www.pearson-studium.de>



Pearson