



# Optionen, Futures und andere Derivate

Das Übungsbuch

10., aktualisierte Auflage

John C. Hull



Pearson

**EXTRAS**  
ONLINE

**Optionen, Futures und andere Derivate**  
**Das Übungsbuch**

# **Optionen, Futures und andere Derivate**

## **- Das Übungsbuch**

### **Inhaltsverzeichnis**

Optionen, Futures und andere Derivate - Das  
Übungsbuch

Inhaltsverzeichnis

Vorwort

Kapitel 1 Einführung

Praktische Fragestellungen

Kapitel 2 Futures-Märkte und zentrale Gegenparteien

Praktische Fragestellungen

Kapitel 3 Absicherungsstrategien mit Futures

Praktische Fragestellungen

Kapitel 4 Zinssätze

Praktische Fragestellungen

Kapitel 5 Bestimmung von Forward- und Futures-Preisen

Praktische Fragestellungen

Kapitel 6 Zins-Futures

Praktische Fragestellungen

Kapitel 7 Swaps

Praktische Fragestellungen

Kapitel 8 Verbriefungen und die Kreditkrise von 2007

Praktische Fragestellungen

Kapitel 9 XVA

# Inhaltsverzeichnis

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 10 Optionsmärkte

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 11 Eigenschaften von Aktienoptionen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 12 Handelsstrategien mit Optionen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 13 Binomialbäume

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 14 Wiener-Prozesse und Itôs Lemma

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 15 Das Black-Scholes-Merton-Modell

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 16 Mitarbeiteroptionen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 17 Optionen auf Aktienindizes und Währungen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 18 Optionen auf Futures und das Black-Modell

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 19 Sensitivitäten von Optionspreisen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 20 Volatility Smiles

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 21 Numerische Verfahren: Grundlagen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 22 Value at Risk



# Inhaltsverzeichnis

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 23 Schätzung von Volatilitäten und Korrelationen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 24 Kreditrisiko

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 25 Kreditderivate

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 26 Exotische Optionen

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 27 Modellierung und numerische Verfahren: Vertiefung

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 28 Martingale und Wahrscheinlichkeitsmaße

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 29 Zinsderivate: Die Standard-Market-Modelle

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 30 Anpassungen: Konvexität, Zahlungstermine und Quantos

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 31 Gleichgewichtsmodelle für die Short Rate

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 32 No-Arbitrage-Modelle der Short Rate

Praktische Fragestellungen

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

Praktische Fragestellungen

## Kapitel 34 Mehr zu Swaps

Praktische Fragestellungen



## **Inhaltsverzeichnis**

Kapitel 35 Energie- und Rohstoffderivate

Praktische Fragestellungen

Kapitel 36 Realoptionen

Praktische Fragestellungen

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