

Roland Eller (Hrsg.)

Handbuch Derivativer Instrumente

Produkte, Strategien, Risikomanagement

2. überarbeitete Auflage

1999
Schäffer-Poeschel Verlag Stuttgart

Inhaltsverzeichnis

Geleitwort	IX
Vorwort des Herausgebers	X
Kapitel I:	
Grundlagen Derivativer Instrumente	1
<i>Roland Eller</i>	
Derivative Instrumente – Überblick, Strategien, Tendenzen	3
<i>Roland Eller</i>	
Risikomanagement von Zinsinstrumenten im Wandel der Zeit	39
<i>Roland Eller</i>	
Kurs- und Performanceindices am deutschen Rentenmarkt	79
<i>Friedrich Munsberg</i>	
Jumbo-Pfandbriefe und Jumbo-Pfandbrief-Future	99
<i>Dr. Hubert-Ralph Schmitt</i>	
Stripping strukturierter Anleihen	121
<i>Dr. Hans-Peter Deutsch</i>	
Risiko: Management von High-Tech Geschäften mit High-Tech Systemen	131
Kapitel II:	
Märkte für Derivate Instrumente	161
<i>Dr. Carl Heinz Daube</i>	
Risikomanagement für Aktienoptionen	163
<i>Heinz Hauser</i>	
Pricing und Risk-Management von Caps, Floors und Swap-Optionen	195
<i>Dr. Andreas Pechtl</i>	
Optionen mit speziellen Eigenschaften (Exotic Options)	233
<i>Hermann Collmann</i>	
Der Reverse Floater	269

Kapitel III:	
Strategien mit Derivaten Instrumenten	297
<i>Andreas Sahl</i>	
Integriertes Hedging von Risiken mit dem Portfolio-Ansatz	299
<i>Stefan Dreesbach</i>	
Derivative Aktienindexprodukte im modernen Portfoliomanagement	309
<i>Roland Eller</i>	
Strategien mit Financial Futures	347
<i>Dr. Christoph Avenarius</i>	
Management von Währungsrisiken	387
<i>Roland Eller</i>	
Zinsswaps – Produktbeschreibung, Pricing und Bewertung	405
<i>Christian Spindler</i>	
Währungsmanagement in internationalen Unternehmen	423
Kapitel IV:	
Management von Derivaten Instrumenten	449
<i>Roland Jauch / Jodok Müller</i>	
Risikomanagement der Raiffeisenbank Kleinwalsertal AG	451
<i>Lutz Krannich</i>	
Risiken der Wertpapierleihe und Wertpapierpensionsgeschäfte	491
<i>Franz M. Dahl</i>	
Derivative Instrumente im Rahmen des Financial Audit	581
<i>Jörg Birkelbach</i>	
• Softwareüberblick Derivativer Instrumente	619
<i>Ulrich Willeitner</i>	
Brady-Bonds – Ein neuer Markt nur für »Yield-hunter«?	661
<i>Paul Hagen / Wolfgang Jakobs</i>	
Markttrisikosteuerung bei Trinkaus & Burkhardt	713

Kapitel V:	
Bewertung, Bilanzierung und aufsichtsrechtliche Belange	
Derivativer Instrumente	729
<i>Dr. Andreas Bertsch / Ralph Kärcher</i>	
Derivative Instrumente im Jahresabschluß und in der Steuerbilanz	731
<i>Dr. Walter Gruber / Roland Raskopf</i>	
Die Behandlung von derivaten Zinsinstrumenten in der Kapitaladäquanzrichtlinie	773
Glossar	801
Stichwortverzeichnis	837