

Financial Engineering

Strategien, Bewertungen und Risikomanagement

3., überarbeitete und erweiterte Auflage

Herausgegeben von
Michael Bloss

Unter Mitwirkung von Manuel Kleinknecht und
Daniel Sörensen

DE GRUYTER
OLDENBOURG

Inhaltsübersicht

Vorwort zur dritten Auflage	VII
Abkürzungs- und Symbolverzeichnis	XXV
Abbildungsverzeichnis	XXXI
Tabellenverzeichnis	XXXIX
Modul I Grundlagen des Financial Engineering	1
1 Financial Engineering – Aufbau und Konzeption	3
2 Die quantitativen Grundlagen des Financial Engineering	19
3 Ethische Grundsätze für ein erfolgreiches Financial Engineering	95
Modul II Plain-Vanilla-Derivate	109
4 Terminbörsen und Terminmärkte	111
5 Futures – unbedingte Termingeschäfte	147
6 Optionen – bedingte Termingeschäfte	186
7 Devisentermingeschäfte und Warentermingeschäfte	313
Modul III Non-Plain-Vanilla-Derivate und Strukturen	361
8 OTC-Derivate und exotische Strukturen	363
9 Kreditderivate	431
10 Wetterderivate	448
11 Börsengehandelte Inflationsderivate	457
12 Versicherungsderivate	463

Modul IV Anwendung von Derivaten und deren Einsatz	471
13 Derivate zur Strukturierung komplexer Portfolios	473
14 Einsatz von Derivaten im Financial Engineering und im Fonds- management	491
15 Die Wertpapierleihe und das Repo-Geschäft	520
16 Risiko- und Sicherheitenmanagement im Derivatehandel	529
 Schlusswort	 573
17 Appendix	575
 Literaturverzeichnis	 614
Index	627