

Roland Eller / Markus Heinrich
René Perrot / Markus Reif (Hrsg.)

Management von Rohstoffrisiken

Strategien, Märkte und Produkte

B 366742



Inhaltsverzeichnis

Geleitwort.....	5
Vorwort.....	7

Teil I

Rohstoffmärkte im Überblick

Rohstoffmärkte im Rahmen globaler Trends	15
<i>Lars Thomsen</i>	
Rohstoffindizes.....	27
<i>Peter Menne</i>	
Der europäische Energiemarkt	45
<i>Jan von Drathen</i>	
Rohstoffe und wirtschaftliche Entwicklung.....	85
<i>Bernhard Herz / Christian Drescher</i>	

Teil II

Risiko- und Treasurymanagement von Rohstoffen

Anforderungen an das Risikomanagement und Risikocontrolling	107
<i>Jan Kühne</i>	
Produkte und Praxisfälle des Risikomanagements	139
<i>Thomas Paschold</i>	
Management von Industriemetallrisiken im Treasurymanagement	157
<i>Wolfgang M. Frontzek</i>	

Energiepreisabsicherung mit Derivaten.....	181
<i>Christoph Braun</i>	
Strukturierte Beschaffung zur Absicherung von Gaspreisrisiken.....	197
<i>Jan von Drathen</i>	
Risikosteuerung am Beispiel ölandizierter Gasverträge, Kohle und Fracht – Praxisbeispiele	213
<i>Julia Kubis / Richard Nickel</i>	
Physische und finanzielle Absicherung von elektrischem Strom	269
<i>Stefan Ulreich</i>	
CO ₂ -Emissionshandel in der Europäischen Union	283
<i>Stefan Ulreich</i>	
Bewertung von Stromderivaten	297
<i>Jan Marckhoff / Matthias Muck</i>	
Preis- und Risikomanagement bei Soft Commodities.....	327
<i>Eva Lambert</i>	

Teil III

Rahmenbedingungen

Bilanzierung von Derivaten des Rohstoffmanagements	345
<i>Olaf Maulshagen / Sven Walterscheidt</i>	
Anforderungen an die Eigenkapitalhinterlegung aus der Solvabilitätsverordnung (SolvV)	373
<i>Markus Mues</i>	
Management von Währungsrisiken bei Rohstoffpreisrisiken.....	391
<i>Anja Baselt / Stefan Welter</i>	
Diversifikations- und »Downside Protection-Potenzial« von Rohstoffportfolios in Multi-Asset-Portfolios	407
<i>Lars Helge Haß / Denis Schweizer</i>	
Univariate und Multivariate Modellierung täglicher Volatilitäten von Rohstoff-Futures	425
<i>Roland Füss / Thorsten Glück / Rolf Tilmes</i>	

Teil IV
Anhang

Glossar445

Die Herausgeber453

Die Autorinnen und Autoren455