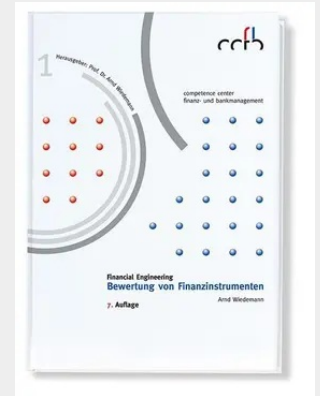


Financial Engineering

Bewertung von Finanzinstrumenten

Financial Engineering zu kennen und zu verstehen ist heute für Marktteilnehmer wichtiger denn je. Ausgehend von einer Einführung in die Finanzmathematik werden zuerst grundlegende symmetrische Produkte (fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Forward Rate Agreements und Swaps) erläutert. Anschließend werden am Beispiel von Aktienoptionen die verschiedenen Optionstypen, deren Bewertungskomponenten und Optionspreismodelle vorgestellt. Diese bilden das Fundament für die Analyse strukturierter Produkte mit Aktienoptionen (Aktienanleihen, Discount-Zertifikate, Index-Anleihen). Des Weiteren werden Zinsoptionen (Anleiheoptionen, Caps, Floors, Collars und Swaptions) diskutiert und hierauf aufbauend ebenfalls strukturierte Produkte (Anleihen mit einfachem und mehrfachem Kündigungsrecht, Reverse Floater, Leveraged Floater, gecapte Constant Maturity Swaps) analysiert. Abgerundet wird das Produktspektrum mit der Analyse von Wandelanleihen und Zertifikaten (u.a. Garantie-, Bonus- und Hebel-Zertifikate). Zum Einsatz kommen Bewertungsverfahren, die auf analytischen Formeln als auch auf Binomialbäumen basieren. Darüber hinaus setzt sich die Monte Carlo Simulation gerade bei Produkten mit komplexen Auszahlungsprofilen zunehmend durch. Schrittweise wird der Leser an die verschiedenen Bewertungstechniken herangeführt. Neu aufgenommen wurde ebenfalls ein Kapitel zur Ethik im Financial Engineering. Dieses Buch liegt nun in der siebten, überarbeiteten und erweiterten Auflage vor.

Financial Engineering zu kennen und zu verstehen ist heute für Marktteilnehmer wichtiger denn je. Ausgehend von einer Einführung in die Finanzmathematik werden zuerst grundlegende symmetrische Produkte (fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Forward Rate Agreements und Swaps) erläutert. Anschließend werden am Beispiel von Aktienoptionen die verschiedenen Optionstypen, deren Bewertungskomponenten und Optionspreismodelle vorgestellt. Diese bilden das Fundament für die Analyse strukturierter Produkte mit Aktienoptionen (Aktienanleihen, Discount-Zertifikate, Index-Anleihen). Des Weiteren werden Zinsoptionen (Anleiheoptionen, Caps, Floors, Collars und Swaptions) diskutiert und hierauf aufbauend ebenfalls strukturierte Produkte (Anleihen mit einfachem und mehrfachem Kündigungsrecht, Reverse Floater, Leveraged Floater, gecapte Constant Maturity Swaps) analysiert. Abgerundet wird das Produktspektrum mit der Analyse von Wandelanleihen und Zertifikaten (u.a. Garantie-, Bonus- und Hebel-Zertifikate). Zum Einsatz kommen Bewertungsverfahren, die auf analytischen Formeln als auch auf Binomialbäumen basieren. Darüber hinaus setzt sich die Monte Carlo Simulation gerade bei Produkten mit komplexen Auszahlungsprofilen zunehmend durch. Schrittweise wird der Leser an die verschiedenen Bewertungstechniken herangeführt. Neu aufgenommen wurde ebenfalls ein Kapitel zur Ethik im Financial Engineering. Dieses Buch liegt nun in der siebten, überarbeiteten und erweiterten Auflage vor.



59,90 €

55,98 € (zzgl. MwSt.)

sofort versandfertig, Lieferzeit: 1-3 Werktage

Artikelnummer: 9783956471278

Medium: Buch

ISBN: 978-3-95647-127-8

Verlag: Frankfurt School Forum

Erscheinungstermin: 01.08.2018

Sprache(n): Deutsch

Auflage: überarbeitete und erweiterte Auflage

Produktform: Gebunden

Gewicht: 1196 g

Seiten: 608

Format (B x H): 172 x 241 mm

