

Videoreihe besteht aus:

1) Vorkenntnisse

- Zeitwert des Geldes
- Zinsrechnungsarten
- Zinsstrukturkurve
- Anleihen
- Nullkuponanleihen und Replikation einer Standardanleihe
- Begriffserklärung Long/Short und Leerverkauf
- Futures und Forwards
- Bid/Ask bzw. Geld/Brief Kurs
- Arbitrage mit und ohne Berücksichtigung von Bid/Ask
- Fremdwährungshandel (FX)
- FX Cross Rates
- Tageszählungskonvention
- Lineare Interpolation

2) Lineare Finanzinstrumente

Forwards

- Forwards Rate Agreements
 - Terminzinsen vs. Kassazinsen
 - Replikation Terminzinsen
 - Arbitrage Terminzinsen
 - FRA Cash Settlement bzw. Ausgleichszahlung
 - FRA Beispiele
- FX Forwards
 - FX Terminkurs vs. Kassakurs
 - FX Forward Replikation
 - FX Forward Arbitrage
 - FX Forward Bewertung bzw. Profit & Loss
 - FX Forward Beispiele

Bondmärkte

- Replikation in Bondmärkten
- Arbitrage in Bondmärkten
- Floater
- Replikation von Floatern
- Bewertung von Floatern
- Floater mit Margin
- Replikation von komplexeren Strukturen
- Duration (DD, BPV, MD)

Swapmärkte

Ermittlung der Zinstruktur (Bootstrapping Methode)

3) Nichtlineare Finanzinstrumente

Futures

- Arbitragefreie Terminkurse
- Futuresbewertung
- Hedging mittels Futures

Optionen

- Optionen Theorie Gewinn/Verlust Profil
- Optionsstrategien
- Put-Call-Parität
- Bewertung von Europäischen Optionen mittels Binomialbäumen
- Bewertung von Amerikanischen Optionen mittels Binomialbäumen
- Bewertung von Optionen mittels Black-Scholes-Modell und Hedging
- Delta-Hedging von Optionsportfolios
- Gamma-Hedging von Optionsportfolios

Ermittlung des Eigenkapitalwertes mittels Black-Scholes-Merton-Modell

4) Corporate Risk Management

Versicherungsberechnungen

- Nutzenkurve und Risikoaversion
- Risikomanagement der einzelnen Haushalte und erwarteter Nutzen
- Profitberechnung von Versicherungsunternehmen
- Risikomanagement der Unternehmen

Diversifikation und Risk-Pooling

- Diversifikation und Risikominderung
- Risk-Pooling

Kapitalstrukturtheorie

- Modigliani & Miller Irrelevanztheorem
- Asymmetrische Information