

Tabellenverzeichnis

Tab. 2.1	Korrelation der internationalen Aktienmärkte (2007) — 60
Tab. 2.2	Korrelationskoeffizienten – Werte und Bedeutung — 63
Tab. 4.1	Hexensabbat — 143
Tab. 4.2	Szenarioerklärung für Zinsinstrumente — 151
Tab. 4.3	Beispiele für ein Handelsbuch (Beispiel hier: Future auf DAX®-Index) — 153
Tab. 5.1	Häufig gehandelte Index-Futures — 177
Tab. 5.2	Grundintentionen von Future-Investoren — 177
Tab. 5.4	Laufzeitenstruktur unterschiedlicher Fixed Income Futures — 180
Tab. 5.5	Grundintentionen im Fixed Income Future Handel — 180
Tab. 5.6	Mögliche FX Futures (Währungskombinationen) — 181
Tab. 5.7	Grundintention von Single Stock Futures — 183
Tab. 5.8	Marktverfassung im Future-Handel — 184
Tab. 5.9	Future-Basis — 186
Tab. 5.10	Berechnung Fixed Income Futures — 190
Tab. 5.11	Übersicht der möglichen Future-Serien am Beispiel des DJ EURO STOXX 50® Futures — 194
Tab. 5.12	Spreads — 199
Tab. 5.13	Betawerte — 206
Tab. 6.1	Rechte und Pflichten bei Optionen — 217
Tab. 6.2	Übersicht der Verfallsmöglichkeiten der einzelnen Serien an der Eurex — 222
Tab. 6.3	Möglichkeiten der Preisstellung — 227
Tab. 6.4	Volatilitäts-Surface DAX® Index — 246
Tab. 6.5	Dividendenzahlungen als Einfluss auf den Optionspreis — 249
Tab. 6.6	Klassische Einflussparameter im Überblick — 252
Tab. 6.7	Übersicht der klassischen Greeks — 252
Tab. 6.8	Vorzeichen Call- und Put-Delta — 254
Tab. 6.9	Deltawerte in der jeweiligen Optionssituation — 254
Tab. 6.10	Vorzeichenübersicht der Greeks — 259
Tab. 6.11	Sensitivitäten des Optionspreises (Beispiele) — 262
Tab. 6.12	Sensitivitätsableitungen des Optionspreis — 263
Tab. 6.13	Die vier Grundpositionen im Optionsgeschäft — 302
Tab. 6.14	Die vier Grundpositionen in der Übersicht und deren Erwartungshaltung — 302
Tab. 6.15	Übersicht über Optionen auf Futures — 333
Tab. 6.16	Trading-Book mit Erweiterungspositionen — 337
Tab. 6.17	Kombinationsmöglichkeiten — 338
Tab. 7.1	Beispiele für die Sprache von Devisenhändlern — 354
Tab. 7.2	Währungsfutures und deren Grundintension — 358
Tab. 7.3	NDF-EUR/BRL Szenarioanalyse — 361
Tab. 7.4	Opening- und Closing-Transaktionen — 363

XXXVIII — Tabellenverzeichnis

Tab. 7.5	Relation zwischen Spot- und Future-Preis — 370
Tab. 7.6	Korrelationsmatrix Commodity — 382
Tab. 8.1	Datenblatt zum Collar (Einzelkomponenten) — 403
Tab. 8.2	Vergleich zwischen Forward und Future — 405
Tab. 8.3	Markterwartung — 421
Tab. 8.4	Szenarioanalyse — 440
Tab. 8.5	Swaptions und deren Gegenposition — 442
Tab. 8.6	Swaption und die nach der Swap-Ausübung bestehende Swap-Position — 443
Tab. 8.7	Eigenschaften von Swaptions — 445
Tab. 8.8	Knock-in-/out-Optionen — 449
Tab. 8.9	Übersicht der Barrier Options — 450
Tab. 8.10	Basket-Option-Preisbildung, Abschluss vs. Fälligkeit — 459
Tab. 9.1	Ausgewählte Banken und deren CDS per 04.10.2023 — 488
Tab. 9.2	Ausgewählte Staaten und deren CDS per 05.10.2023 — 489
Tab. 13.1	Beispiel-Portfolio und Erweiterung durch Termingeschäfte — 526
Tab. 16.1	Vergleich EUREX CLEARING Prisma und Risked Bases Margin System — 608
Tab. 17.1	Weltweite durchschnittliche Ausfallrate kumuliert von 1981–2016 in Prozent — 661