

Peter Albrecht / Raimond Maurer

Investment- und Risikomanagement

Modelle, Methoden, Anwendungen

4., überarbeitete Auflage

2016

Schäffer-Poeschel Verlag Stuttgart

Inhaltsübersicht

Teil I: Institutionelle und methodische Grundlagen

1	Allgemeine Grundlagen des Investment- und Risikomanagements	3
2	Charakterisierung von Investments unter Sicherheit	59
3	Charakterisierung von Investments unter Risiko I: Einperiodenmodelle	107
4	Charakterisierung von Investments unter Risiko II: Mehrperiodenmodelle	187
5	Grundlagen der Bewertung von Investments unter Risiko	255

Teil II: Investment- und Risikomanagement primärer Finanztitel

6	Aktieninvestments: Grundlagen	309
7	Aktieninvestments: Vertiefung	437
8	Investments in Zinstitel: Grundlagen	513
9	Investments in Zinstitel: Vertiefung	601

Teil III: Investment- und Risikomanagement mit derivativen Finanztiteln

10	Forwards und Futures	671
11	Optionen	739
12	Swaps	901

Teil IV: Weiterführende und vertiefende Fragestellungen

13	Asset Allocation und Internationale Investments	949
14	Immobilien und alternative Investments	999
15	Ausfallbedrohte Zinstitel	1071