

Stichwortverzeichnis

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Abschlag -> Discount						
Abwicklungsrisiko	41	7.1.2.2				
Adressgewichtung	43	7.3.2				
Aktienrisiko	45	7.3.3.3				
aktiver Partner	28	4.2.5				
Aktivswap -> Asset-Swap						
Alternative Option	14	3.3.5				
Amerikanische Option	11	3.3				
Amerikanischer Tender	38	6.1.4				
amortisierende Anleihe	19	4.1.2.1				
amortisierende Tilgung	20	4.1.2.2				
Amortising	29	4.2.5.1				
Antizyklische Systeme	35	5.2.2.2				
Arangeur	28	4.2.5				
Arbitrage	21	4.2.1	22	4.2.2.1		
Arrangeur	28	4.2.5				
Asian Option	14	3.3.5				
Asset-Market-Approach -> Finanzmarktansatz						
Asset-Market-Approach -> Finanzmarktansatz						
Asset-Swap	29	4.2.5.1	30	4.2.5.1.2		
Assignment	31	4.2.5.4				
Athentizitätsnachweis	18	4.1.1.4				
ATM - Forward (at the money) Am Geld	11	3.3				
Aufschlag -> Premium						
Ausgleichszahlung	21	4.2.1.1				
Auslandsanleihe	19	4.1.2.1				
Average-rate Option -> Asian Option						
Back-Testing	42	7.2.3				
Balkenchart	34	5.2.1.2				
Bankbuch	43	7.3				
Barrier Option -> Knock-out-Barrier Option						
Barwertberechnung (Present Value)	8	2.2				
Baseler Komitee	46	7.3.5				
Basispreis	11	3.3				
Basisrisiko	25	4.2.3	26	4.2.3	40	7.1.1.3
Basis-Swap	29	4.2.5.1				
Basiswährung	10	3.1				
Basiswert	11	3.3				
Basket Option	15	3.3.5				
BBA (British Bankers Association)	16	4.1.1.1				
Bear Spread	12	3.3.2.2				
Bestandsgrößenmodell	34	5.1.2.1.2				
Better-of Option	15	3.3.5				
Bewertung -> Mark-to-Market						
BIZ (Bank für internationalen Zahlungsausgleich)	38	6.2				
Black-Scholes-Modell	13	3.3.3				
Break-Even Zins	8	2.2				
Bretton Woods	4	1.4	4	1.5		
Bull Spread	12	3.3.2.2				
Bundfuture	25	4.2.3				
Call	11	3.3				
Call-Put Parität	13	3.3.3				
Call-Swaption	32	4.2.6.4				
Candle-Stick Chart	35	5.2.1.4				
CAP	31	4.2.6.2				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
CD (Certificates of Deposit)	17	4.1.1.2				
Chartanalyse	34	5.2.1				
Cheapest to deliver -> CTD						
Chooser Option	15	3.3.5				
Clean Depot	16	4.1.1.1				
Clean Price	18	4.1.2.1	19	4.1.2.1		
Clearing-House	23	4.2.2.1				
Closing out	31	4.2.5.4				
Collar	33	4.2.6.5				
Compound Option	14	3.3.5				
Contigent Option	14	3.3.5				
CP (Commercial Papers)	18	4.1.1.4				
Cross Currency Swap	29	4.2.5.1				
Cross-Currency Repo	28	4.2.4				
Cross-rates	10	3.1				
CTD (cheapest to deliver)	25	4.2.3				
Cubic Spline	8	2.1.3				
Deferred-Strike Option	14	3.3.5				
Delivery	25	4.2.3				
Delta	13	3.3.4				
Depot -> Interbank Depot						
Devisenbewirtschaftung	4	1.3				
Devisenoption	11	3.3				
Devisenpensionsgeschäfte	38	6.1.5				
Devisenswap	11	3.2.2				
Devisentermingeschäft (Outright)	11	3.2.2				
Digitale Option	15	3.3.5				
Dirty Price	18	4.1.2.1	19	4.1.2.1		
Discount	10	3.2.1				
Diskontierungsbasis	18	4.1.1.4				
Diskontinstrument	18	4.1.1.3				
Diskontpolitik	37	6.1	37	6.1.2.1		
Diskontzins	8	2.2				
Doji	35	5.2.1.4				
Dollar Repo	27	4.2.4				
Double Dipping	27	4.2.4				
Dual Option -> Alternative Option						
Duration	20	4.1.2.4	41	7.2.2		
Durationsmethode	45	7.3.3.2				
Durchschnittszins	8	2.2				
ECP (European CP)	18	4.1.1.4				
ECU (European Currency Unit)	5	1.7				
EDSP (Exchange Delivery Settlement Price)	22	4.2.2.1	25	4.2.3		
Effective Duration -> Duration						
Effektivzins	8	2.2	8	2.3.2		
EFWZ (Europ Fond f. währungspol. Zusammenarbeit)	5	1.7				
Eigenkapitalbedarf	43	7.3.2				
Elliot Wave Theorie	35	5.2.1.5				
Emissionsprogramme	17	4.1.1.2				
Endwertberechnung (Future Value)	8	2.2				
Engulfing	35	5.2.1.4				
EONIA-Swap (Overnight Index Average Swap)	30	4.2.5.1.3				
Epsilon	14	3.3.4				
Ergänzungskapital	43	7.3				
ESZB (Europäisches System der Zentralbanken)	5	1.8	39	6.3		
EURIBOR (European Interbank Offered Rate)	22	4.2.2.1				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Euroanleihe	19	4.1.2.1				
Euroanleihen -> Eurogeldmarkt						
Eurogeldmarkt	17	4.1.1.1				
Europäische Option	11	3.3				
EWA (Europäische Währungsabkommen)	4	1.4				
EWI (Europäisches Währungsinstitut)	6	1.8	38	6.2		
EWS (Europäisches Währungssystem)	5	1.7				
EWV (Europäischer Währungsverbund)	5	1.7				
EWU (Europäische Wirtschafts- und Währungsunion)	5	1.8				
EWU-Rat	5	1.8				
Exchange Delivery Settlement Price -> EDSP						
Exercise day	11	3.3				
Exotic Options	14	3.3.5				
Expiration day	11	3.3				
EZB (Europäische Zentralbank)	39	6.3				
EZB Ratsmitglieder	39	6.3				
EZU (Europäische Zahlungsunion)	4	1.4				
Fazilitäten	37	6.1.2.2				
Festzinszahler -> Fixed-Rate-Payer						
Fibonacci	35	5.2.1.5				
Final Exchange (Schlußtransaktion)	31	4.2.5.2				
Financial Swap	28	4.2.5				
Finanzmarktansatz (Asset-Market-Approach)	34	5.1.2.1.3				
Fixed-Rate-Payer	28	4.2.5				
flatquotation -> Dirty price						
Flex Repo	28	4.2.4				
Floating Rate Repo	28	4.2.4				
Floating-Rate-Payer	28	4.2.5				
FLOOR	32	4.2.6.3				
FOMC (Federal Open Market Committee)	39	6.3				
Formationen	35	5.2.1.2.3				
Forward Start Repo	28	4.2.4				
Forwardsätze	8	2.2				
Forward-Start-Swap	29	4.2.5.1				
FRA (Forward Rate Agreement)	21	4.2.1				
FRABBA (FRA British Bankers Association)	21	4.2.1.1				
Fraktale Geometrie	36	5.2.2.4				
Fundamentalanalyse	34	5.1				
Funds-Basis	10	3.1				
Futures	22	4.2.1.4.2	22	4.2.2.1		
Gamma	13	3.3.4				
GAP Methode	41	7.2.2				
Garman & Kohlhagen-Modell	13	3.3.3				
Geldmarkt	7	2.1	8	2.2		
Geldschöpfung	37	6.1.3.2				
General Collateral	27	4.2.4				
Goldkernwährung	4	1.2				
Goldkonvertibilität	4	1.5				
Goldstandard	4	1.2				
Großkreditgrenzen	46	7.3.3.3				
Haircut	23	4.2.2.1	27	4.2.4		
Hamsteroption	15	3.3.5				
Handelsbuch	43	7.3				
Händlerlimit	42	7.2.4.2				
Hedge	13	3.3.4	21	4.2.1	22	4.2.2.1
HIC Repo (Hold in custody)	27	4.2.4				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Historische Simulation	42	7.2.3				
Hold in custody Repo -> HIC						
Holländischer Tender	38	6.1.4				
IMM Dates	21	4.2.1.1				
Impulswelle	35	5.2.1.4				
Inhaberschuldverschreibung -> Schuldverschreibung						
Initial Exchange (Anfangstransaktion)	31	4.2.5.2				
Initial Margin	23	4.2.2.1	27	4.2.4		
Innerer Wert	12	3.3				
Instrumenten-Limit -> Händlerlimit						
Integrierte Modelle	34	5.1.2				
Interbank Depot	16	4.1.1.1				
Internationale Anleihe -> Eurogeldmarkt						
Intraday-Hedging	26	4.2.3				
Intradaylimit -> Händlerlimit						
IRS (Interest-Rate-Swap) -> Financial Swap						
ISDA (Swap Dealer Association)	21	4.2.1.1				
ISMA (International Securities Market Association)	19	4.1.2.1	20	4.1.2.2		
ITM - Forward (in the money) Im Geld	11	3.3				
IWF (Internationaler Währungsfonds)	4	1.4				
Kapitalmarkt	7	2.1	8	2.3		
Kapitalmarkt-Future	26	4.2.3.4				
Kappa -> Vega						
KAR (Kapitaladäquanzrichtlinie CAD engl.)	43	7.3	46	7.3.5		
Kassamarkt	10	3.1				
Kaufkraftparitätentheorie	34	5.1.1.1				
Kernkapital	43	7.3				
Keynesianisches Modell	34	5.1.2.1.1				
Knock-in Option	15	3.3.5				
Knock-out-Barrier Option	14	3.3.5				
Komparativer Vorteil	30	4.2.5.1.2	31	4.2.5.2		
Konfidenzintervall	46	7.3.5				
Kontraktgröße	24	4.2.2.3	26	4.2.3.4		
Konvergenzkriterien	6	1.8				
Konversionsfaktor	25	4.2.3				
Konvexität	20	4.1.2.4				
Korrekturwelle	35	5.2.1.4				
Kreditarbitrage	30	4.2.5.1.2				
Kreditrisiko	41	7.1.2	43	7.3.2		
Kreditrisikolimit	42	7.2.4				
Kupon-Swap	29	4.2.5.1				
Kurztender	39	6.3				
Ladder Option	14	3.3.5				
Laufzeitbandmethode	45	7.3.3.2				
Laufzeit-mismatch-Limit -> Händlerlimit						
Liability-Swap	29	4.2.5.1	30	4.2.5.1.2		
LIBID (London Interbank Bid Rate)	16	4.1.1.1				
Libor (London Interbank Offered Rate)	16	4.1.1.1				
Libor Spread	30	4.2.5.1.2				
Liefertage	22	4.2.2.1				
Linienchart	34	5.2.1.1				
Liquidationsnetting	44	7.3.2				
Liquiditätspolitische Aspekte	37	6.1.3.2				
Lock-in Option	15	3.3.5				
Lombardpolitik	37	6.1.2.2				
Look-Back Option	14	3.3.5				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Louvre Abkommen	5	1.6				
Maastricht	5	1.8				
MACD (Moving Average Conversion Diversion)	35	5.2.2.1				
Margin	18	4.1.1.4	23	4.2.2.1		
Margin call	27	4.2.4				
Mark-to-Market	41	7.1.2.3				
Marktrisiko	40	7.1.1	45	7.3.3		
Marktrisikolimit	42	7.2.4.2				
Mathematische Verfahren	35	5.2.2				
Mengentender	38	6.1.4				
Minde-reservepolitik	37	6.1.3				
Mittler	28	4.2.5				
MM-Future	22	4.2.2.1				
Modified Duration -> Duration						
Momentum	35	5.2.2.2.1				
Monetärer Ansatz	34	5.1.2.1.2				
Money-market- Futures	22	4.2.2.1				
Monokausale Erklärungsansätze	34	5.1.1				
Monte-Carlo Simulation	42	7.2.3				
Moosmüller Methode	20	4.1.2.2				
Moving Averages	35	5.2.2.1				
Namenschuldverschreibung -> Schuldverschreibung						
Netting	29	4.2.5.1				
Neuronale Netze	36	5.2.2.4				
Nominalzins	8	2.2				
Notenbankpolitik	37	6				
Notional Amount	29	4.2.5.1				
Novationsnetting	44	7.3.2				
Offenmarktpolitik	37	6.1.4				
Open Repo	28	4.2.4				
Open/Cose	22	4.2.2.1				
Optionspreismodelle	12	3.3.3				
Optionspricing	12	3.3.3				
Oszillator	35	5.2.2.1				
OTC (Over the counter)	21	4.2.1				
OTM - Forward (out of the money) Aus dem Geld	11	3.3				
Overbought, -sold	36	5.2.2.2.2				
Overnight Index Average Swap -> EONIA-Swap						
Overnightlimit -> Händlerlimit						
Par-Value-Swap	31	4.2.5.2				
Passivswap -> Liability-Swap						
Payer-Swaption	32	4.2.6.4				
Pensionsgeber/-nehmer	26	4.2.4				
Pensionsgeschäfte	26	4.2.4				
Perpetual Bond	19	4.1.2.1				
Point&Figure Chart	35	5.2.1.3				
Preissensitivität	20	4.1.2.4				
Premium	10	3.2.1				
Premium payment day	11	3.3				
Present Value of a Basispoint	41	7.2.2				
Primärmarkt	17	4.1.1.3				
Put	11	3.3				
Put-Swaption	32	4.2.6.4				
Quotierung, direkte -, indirekte -	10	3.1				
Quotierungslimit -> Händlerlimit						
Rating	18	4.1.1.4				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Realzins	8	2.2				
Rebate Option	15	3.3.5				
Receiver-Swaption	32	4.2.6.4				
Referenzsatz	21	4.2.1.1				
Refinanzierungspolitik	37	6.1.2				
Repo	26	4.2.4	27	4.2.4		
Reset-date	29	4.2.5.1				
Retracement	35	5.2.1.5				
Reversal	31	4.2.5.4				
Reverse Repo	27	4.2.4				
Reverse to Maturity Repo	28	4.2.4				
Rho -> Epsilon						
Ricardo, David -> komparative Vorteile						
Roller Coster	29	4.2.5.1				
RSI (Relative-Stärke-Index	36	5.2.2.2.2				
Schuldschein	17	4.1.1.4				
Schuldverschreibung	18	4.1.1.4	18	4.1.2.1	19	4.1.2.1
Securitization	18	4.1.1.4				
Security Lending	28	4.2.4				
Sekundärmarkt	16	4.1.1	17	4.1.1.2	18	4.1.1.3
selffulfilling-prophecies	34	5.2.1				
Sell and buy back	27	4.2.4				
Sensitivitätsmodelle	45	7.3.3.2				
Settlement day	11	3.3				
sinking funds	19	4.1.2.1				
Smithsonian Agreement	4	1.5				
Span-Margin	23	4.2.2.1				
Special Collateral	27	4.2.4				
spot-next (s/n)	11	3.2.2				
Spread	10	3.1				
Spread Margin	23	4.2.2.1				
Stepup	19	4.1.2.1	29	4.2.5.1		
stochastischer Prozess	36	5.2.2.3	42	7.2.3		
Stop-Loss-Limit -> Händlerlimit						
Straddle	12	3.3.2.2				
Strangle	12	3.3.2.2				
Stress-Testing	42	7.2.3				
Stromgrößenmodell	34	5.1.2.1.1				
Subminuettenwelle	35	5.2.1.5				
Substitutionsvereinbarung	27	4.2.4				
Superzyklus	35	5.2.1.5				
Swappunkte	10	3.2.1				
Swaption	32	4.2.6.4				
Swiftcode	10	3.1				
Tagesgelduntergrenze	37	6.1.2.2				
T-bill	17	4.1.1.3				
Terminmarkt	10	3.2.1				
Theta	13	3.3.4				
Tick	22	4.2.2.1	22	4.2.2.3	26	4.2.3.4
Tier	43	7.3				
tom-next (t/n)	11	3.2.2				
Treasury-Bills	17	4.1.1.3				
Trendbestätigung	35	5.2.1.2.3				
Trendfolgesysteme	35	5.2.2.1				
Trends	34	5.2.1.2.1				
Trendumkehr	35	5.2.1.2.3				

Stichwortverzeichnis	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel	Seite	Kapitel
Triggerpoint	27	4.2.4				
Triparty Repo	27	4.2.4				
Trust me Repo -> HIC Repo						
Underlying	22	4.2.2.1				
Unterstützungslinien	34	5.2.1.2.2				
Up-Front-Zahlung	31	4.2.5.4				
Ursprungsrisikomethode	44	7.3.2.2				
US-style Repo -> Repo						
VAR (Value at Risk)	41	7.2.3				
Varianz-Kovarianz-Methode	42	7.2.3				
Variation-Margin	23	4.2.2.1				
Vega	13	3.3.4				
Volatilität	12	3.3	13	3.3.4		
Währungsreservepolitik	37	6.1.1				
Währungsrisiko	45	7.3.3.1				
Währungsswap -> Cross Currency Swap						
Wandelanleihe	19	4.1.2.1				
Wechsel	17	4.1.1.3				
Wechselkursmodell -> Keynesianisches Modell						
Weighted-rate Option -> Asian Option						
Widerstandslinien	34	5.2.1.2.2				
Wiederbeschaffungsrisiko	41	7.1.2.3	44	7.3.2.2		
Zeitreihenanalyse	36	5.2.2.3				
Zeitwert	12	3.3				
Zeroanleihe	19	4.1.2.1				
Zero-Cost Collar	33	4.2.6.5				
Zero-Kurve	20	4.1.2.3				
Ziehungsrechte, ordentliche	4	1.4				
Zinsfutures -> Futures						
Zinskurve	8	2.1.2				
Zinsoption	31	4.2.6.2				
Zinsparitätentheorie	34	5.1.1.2				
Zinsrisiko	40	7.1.1.2	45	7.3.3.2		
Zinsswap	29	4.2.5.1				
Zinstender	38	6.1.4				