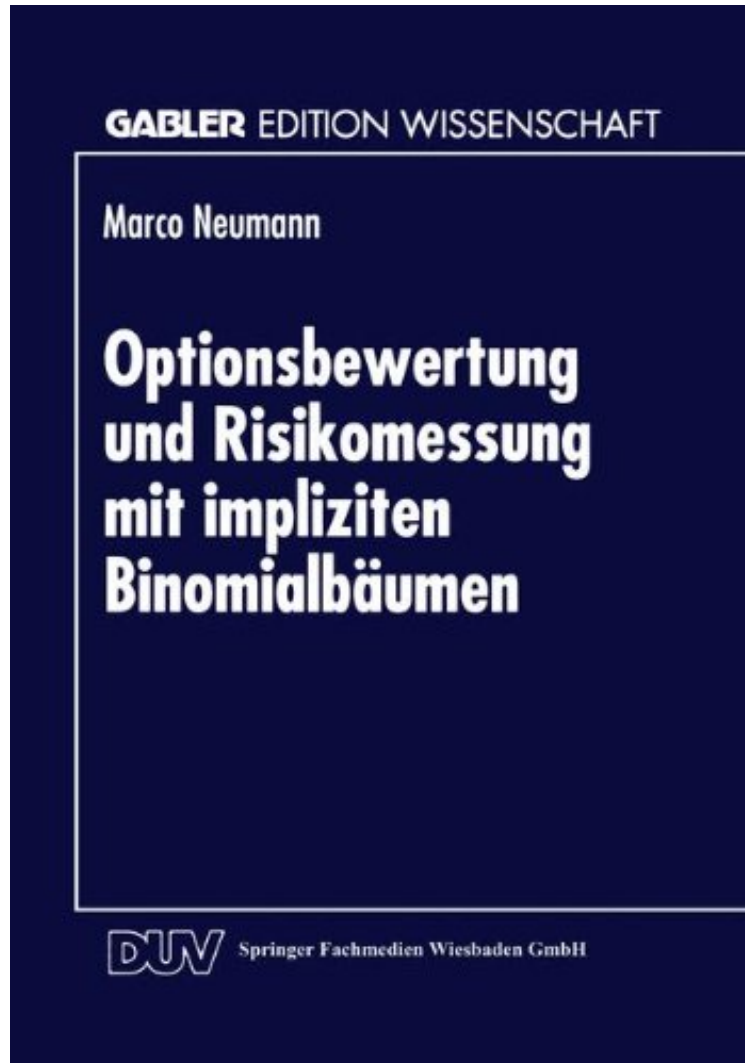


(Download free pdf) Optionsbewertung und Risikomessung mit Impliziten Binomialbäumen

Optionsbewertung und Risikomessung mit Impliziten Binomialbäumen

Von Marco Neumann

*Download PDF | ePub | DOC | audiobook | ebooks



DOWNLOAD



+

READ ONLINE

Produktinformation -Verkaufsrank: #8998788 in BcherVerffentlicht am: 2013-10-04Erscheinungsdatum: 2013-10-04Abmessungen: 8.27 x .55b x 5.83l, .64 Pfund Einband: Taschenbuch240 Seiten | File size: 30.Mb

Von Marco Neumann : Optionsbewertung und Risikomessung mit Impliziten Binomialbäumen before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Optionsbewertung und Risikomessung mit Impliziten Binomialbäumen:

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen3 von 3 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Fr Praktiker und Theoretiker geeignete EinfhrgungVon Ein KundeDas Werk "Optionsbewertung und Risikomessung mit impliziten Binomialbäumen" von Marco Neumann entstand aus einer an der Uni Karlsruhe geschriebenen Dissertation.

Und dennoch - soviel sie gleich vorweg gesagt - ist das Buch erstaunlich lesbar. Das Buch beschäftigt sich mit diskreten Methoden der Optionsbewertung und auch der Risikomessung. Dazu wird die Technik der Binomialbäume extensiv angewendet. Dies hat den großen Vorteil der intuitiven Nachvollziehbarkeit. Einen breiten Raum nimmt auch die Risikomessung mittels des Binomialmodells ein - ein bisher wenig betrachteter Anwendungsaspekt. Der Band schließt mit einem Kapitel mit empirischen Untersuchungen, in denen die entwickelten Konzepte an der Praxis verifiziert wurden. Wie bei einer Dissertation nicht anders zu erwarten, wird das Werk durch zahlreiche weiterführende Literaturhinweise ergänzt. Der einzige Wehrmutstropfen ist das Fehlen eines Stichwortverzeichnisses. Dieses Manko wird aber weitgehend durch das ausführliche Inhaltsverzeichnis kompensiert, welches das Auffinden des gesuchten Themas erheblich erleichtert. Insgesamt also ein durchaus gelungenes und originäres Werk und die erste Gesamtdarstellung des Anwendungsbereichs für die Technik der Binomialbäume in deutscher Sprache. (Dies ist eine .de an der Uni-Studentenrezension.)

Kurzbeschreibung Bei der marktorientierten Bewertung von Aktien werden der Preisprozess und die Verteilung des Basiswertpapiers zur Vermeidung der Fehlspezifikation implizit aus den Marktpreisen von Optionen ermittelt. **Buchrückseite** Bei der marktorientierten Bewertung von Aktien werden der Preisprozess und die Verteilung des Basiswertpapiers zur Vermeidung der Fehlspezifikation implizit aus den Marktpreisen von Optionen ermittelt. Die Anwendung dieses Konzeptes zur Bewertung der DAX-Option zeigt, dass dadurch alle Optionen eines Fälligkeitzeitpunktes gleichzeitig arbitragefrei bewertet werden können. Das auf diese Weise geschätzte verallgemeinerte Binomialmodell ist somit auch der geeignete Rahmen zur Risikomessung mit dem Value-at-Risk. **ber den Autor und weitere Mitwirkende** Dr. Marco Neumann promovierte am Institut für Entscheidungstheorie und Unternehmensforschung bei Prof. Dr. Hermann Gppl an der Universität Karlsruhe, wo er heute als wissenschaftlicher Mitarbeiter tätig ist.