



Sebastian Wessels

Performancemessung von Optionsportfolios und deren Anwendung zur Margenschätzung bei strukturierten Finanzprodukten

Im Zuge der Performancemessung von Fonds oder Portfolios, die Optionen beinhalten, stoßen klassische faktorbasierte Performance-maße an ihre Grenzen, da diese nicht in der Lage sind, optionsspezifische Charakteristika abzubilden. Dadurch wird letztlich der Performanceausweis verfälscht. Sebastian Wessels beleuchtet die Verwendung von optionsspezifischen Faktoren, mit deren Hilfe ein adäquater Performanceausweis für Fonds oder Portfolios mit Optionen gewährleistet werden soll.

Darauf folgend richtet er das Augenmerk auf strukturierte Finanzprodukte und deren Besonderheit: Emittenten treten als Market Maker auf und die gestellten Produktpreise enthalten eine Marge. Sebastian Wessels stellt einen innovativen Ansatz zur Schätzung der Marge bei strukturierten Finanzprodukten vor, der sich an Methoden aus dem Bereich der Performancemessung von Fonds orientiert und diese mit Erkenntnissen aus der Optionspreistheorie verknüpft.

2021, 220 S., 15 s/w Abb.,

18 s/w Tab., kart.,

41,- €, 978-3-8305-5110-2

eBook PDF 978-3-8305-4331-2

(Neue Betriebswirtschaftliche Studienbücher Bd. 44)

DER AUTOR

Sebastian Wessels, geb. 1986, Studium der Mathematik an der WWU Münster. 2020 Promotion an der FernUniversität in Hagen, seit 2015 wissenschaftlicher Mitarbeiter am Lehrstuhl für Bank- und Finanzwirtschaft an der FernUniversität in Hagen. Forschungsschwerpunkte: Performancemessung, Derivatebewertung, strukturierte Finanzprodukte, Regret-Theorie.

AUS DEM INHALT

Optionen und strukturierte Finanzprodukte | Bewertungstheorie | Performancemessung | Performancemessung von Optionsportfolios bei stochastischer Volatilität | Margenschätzung bei strukturierten Finanzprodukten |

Berliner Wissenschafts-Verlag | Behaimstr. 25 | 10585 Berlin

Tel. 030 84 17 70-0 | Fax 030 84 17 70-21

www.bvw-verlag.de | bwv@bvw-verlag.de



Berliner
Wissenschafts-Verlag

BESTELLSCHEIN

Hiermit bestelle ich*

..... Ex. ISBN 978-3-8305-..... je €
..... Ex. ISBN 978-3-8305-..... je €
..... Ex. ISBN 978-3-8305-..... je €
..... Ex. ISBN 978-3-8305-..... je €

Sie haben auch die Möglichkeit, Titel aus unserem Verlagsprogramm über unseren Onlineshop zu bestellen; E-Books sind ausschließlich dort erhältlich: www.bwv-verlag.de

ZAHLUNGSART

Rechnung

(Innerhalb Deutschlands liegt die Rechnung der Lieferung bei. Lieferung ins Ausland gegen Vorabrechnung.)

SEPA-Lastschrift

Ich/Wir ermächtige(n) die Berliner Wissenschafts-Verlag GmbH, Zahlungen von meinem/unserem Konto mittels Lastschrift einzuziehen. Zugleich weise(n) ich/wir mein/unser Kreditinstitut an, die von auf mein/unser Konto gezogenen Lastschriften einzulösen:**

.....
Kontoinhaber (Name, Vorname)

.....
Anschrift (falls abweichend)

.....
IBAN

.....
BIC

** Es gelten die unter <https://www.bwv-verlag.de/wb/?node=texte.sepa> aufgeführten Konditionen. Gläubiger-Identifikationsnummer: DE89ZZZ00000672614.

.....
Datum | 1. Unterschrift

ABSENDER

.....
Name Vorname

.....
Institution

.....
Straße Hausnr. | Zusatz

.....
Postleitzahl Ort

.....
E-Mail

* Preise inkl. MwSt. [D], sofern nicht anders angegeben. Preisänderungen und Irrtümer vorbehalten. Lieferung versandkostenfrei in Deutschland; ins Ausland zzgl. Versandkostenpauschale von 7,95 € pro Versandstück. E-Books zum Download erhältlich unter www.bwv-verlag.de. Wir sind berechtigt, Ihnen Informationen über Waren und Dienstleistungen, die den von Ihnen in Anspruch genommenen ähneln, zuzusenden. Dieser Verwendung können Sie jederzeit per E-Mail an newsletter@bwv-verlag.de widersprechen, ohne dass Ihnen andere Kosten als die Übermittlungskosten nach den Basistarifen entstehen. Als Verbraucher haben Sie das Recht, diesen Vertrag ohne Angabe von Gründen binnen 14 Tagen ab Erhalt der Ware zu widerrufen. Die Kosten der Rücksendung trägt der Verlag. Aktualisierungslieferungen werden automatisch vorgemerkt und nach Erscheinen berechnet und geliefert. Diese Fortsetzungen können jederzeit abbestellt werden. Ein Widerrufsrecht für elektronische Datenträger besteht nicht, wenn die Versiegelung der Verpackung entfernt wurde. Sämtliche Informationen zu Ihrem gesetzlichen Widerrufsrecht, unseren AGB und Hinweise zum Datenschutz finden Sie unter www.bwv-verlag.de. Gerne senden wir Ihnen diese Informationen auf Ihren Wunsch zu. Bitte rufen Sie uns an unter Tel. 030-84 17 70-0.

.....
Datum | 2. Unterschrift

Berliner Wissenschafts-Verlag | Behaimstr. 25 | 10585 Berlin

Tel. 030 84 17 70-0 | Fax 030 84 17 70-21

www.bwv-verlag.de | bwv@bwv-verlag.de



Berliner
Wissenschafts-Verlag