

Stichwortverzeichnis

- A** Additional Margin 191 ff.
 Agrarmärkte 161
 Algorithmen 301
 American Style 32
 Amerikanische Option 32
 Amibroker 21
 Am Geld 33
 Anfänge des Terminhandels 25
 Annualisierten Standardabweichung 79
 Antike 25
 Arbitrage 116
 Arbitragestrategie 124
 Arbitrageure 26
 ATM – At the money (Am Geld) 33
 Aus dem Geld 33
 Auslenkung 210
 Ausschüttung 70
 Außerbörsliche Optionen 33
 Ausübung 32, 214
- B** Backtest 207
 Barausgleich 32
 Basispreis 31
 Basiswert 31
 Bear-Spread 173
 Bernoulli-Nutzenfunktion 82
 Bestandhaltungskosten 164
 Bezugsverhältnis 33
 Binomialmodell 48
 Black-Scholes-Modell 47, 105
 Bonus-Strategien 196
 Bonuszahlung 222
 Börsencrash 132
 Broker 20
 Bull-Spread 172
 Butterfly 178
- C** Calendar-Spread 180
 Call 28
 Capped Bonus-Strategien 196
 Cash Settlement 32
 CCR-Modell 48
 Chartprogramm 21
 Clearingmitglieder 188
 Clearingstelle 161
 Combo-Order 169
 Commodities 161
 Condor 179
 Continuously compounded Volatility 138
 Cost of Carry 163
 Covered Call 43
 Cox-Ross-Rubinstein-Modell 48, 105
 Cross Margining 190
 Currency Futures 161
- D** Deckung 34
 Delta 91
 Deltaneutral 91, 96, 115
 Derivate 28
 Diagonal-Bear-Spread 182
 Diagonal-Bull-Spread 181
 Disziplin 23
 Dividenden 34
 – amerikanische Aktienoptionen 72
 – europäische Aktienoptionen 71
 Dividendenberechtigt 34
 Dividendensprung 71 f.
 Dividendenstrategien 292
 Dividendentermin 58
- E** Effizienter Markt 121
 Effizienzmarkthypothese 132
 Einflussfaktoren auf die Optionsprämie 47
 Erfüllungstermin 162
 Erwartungswert 134
 Europäische Option 32
 European Style 32
 Exercise 32
 Expiration 32
- F** Fachwissen 19
 Fairer Optionspreis 105
 Fair Value 105
 Fat Tails 134
 Financial Futures 161
 Finanzierungskosten 63
 Fit 133
 Follow-up-Aktion 201, 333
 Forward 162
 free lunch 116
 Fungibilität 136
 Future 13, 161
 Future Spread – Margin 193
- G** Gamma 95
 Gauß'sche Glockenkurve 134
 Gewinn 34
 Glatstellen 136
 Grundpositionen 35
- H** Handelsansatz 18, 195
 Häufigkeitsverteilung 132
 Hauptversammlung 70
 Hebel 104
 Hedger 26
 Historische Volatilität 79
 Historische Volatilität nach Fend 87

- I** Im Geld 33
 - Implizite Volatilität 57
 - Initial-Margin 187
 - Innerer Wert 47f.
 - Interest Rate Futures 161
 - Investox 21
 - ITM – In the money (Im Geld) 33
- J** Julianische Zahl 301
- K** Kassamarkt 163
 - Kassapreis 164
 - Kauf 33
 - Kauf einer Kaufoption 35
 - Kauf einer Verkaufsoption 39
 - Kaufoption 28
 - Künstlichen Intelligenz 334
 - Kursindex 74
 - Kurz- bis mittelfristige Strategien 196, 257
- L** Langfristige Strategien 196
 - Lognormalverteilung 138
 - Long 34
 - Long Call 35
 - Long Put 39
- M** Margin 161, 187
 - Margin-Belastung 190
 - Margin Call 189
 - Margin Intervall 190
 - Margin-Klasse 191
 - Market-Maker 124
 - Markteinschätzung 335
 - Markteinstieg 212
 - Marktmodell 135
 - Mark to Market 192
 - MetaStock 21
 - Mindestanforderungen 19
- N** Nachschusspflicht 162
 - Naked 34
 - Normalverteilung 134
- O** Offene Kontrakte 162
 - Omega 104
 - Open Interest 162
 - Optionen 27
 - Optionsprämie 31
 - Optionspreismodell 47, 105
 - Optionsrecht 28
 - Optionsserie 33
 - Optionssimulator 20
 - Optionssmile 131
 - OTM – Out of the money (Aus dem Geld) 33
 - Outperformance-Strategien 196, 242
 - Over the counter 33
- P** Papertrader 21
 - Paritätsformel 121, 128
 - Performanceindex 74
 - P/L 34
 - Positionsgröße 195
 - Premium Margin 192
 - Profit/Loss 34
 - Protective Put 45
 - Put 30
 - Put/Call-Parität 121
- Q** Quantifizierung des Risikos 190
- R** Random Walk 108
 - Ratio-Call-Spread 176
 - Ratio-Put-Spread 177
 - Renditeklassen 133
 - Restlaufzeit 54
 - Rho 103
 - Risiko 79
 - Risikoloser Marktzins 63, 126
 - Risk Based Margining 190
 - Rohstoffe 161
 - Rollen des Systems 209
 - Ruhiger Kursverlauf 156
- S** Senke 199
 - Sensitivitätskennzahlen 89
 - Settlementpreise 124
 - Short 34
 - Short Call 37
 - Short-Positionen 34
 - Short Put 41
 - Short-Selling 277
 - Single-Stock-Future 161, 166
 - Skalierung der Volatilität 80
 - Skew 131
 - Slippage 170
 - Smile 131
 - Sneer 131
 - Soft-Commodities 161
 - Sondervermögen 166
 - Spekulanten 26
 - Spot Price 164
 - Standardabweichung 136
 - Standardisierung 34
 - Step, Binomialmodell 108
 - Stillhalter 28
 - Stock-Index-Futures 161
 - Straddle 174
 - Strangle 175
 - Strategieentwurf 335
 - Strategien auf Volatilitäts-Futures 273
 - Strategien für Vermögensverwalter 333
 - Strategien mit Calendar-Spreads 282
 - Strategieoptimierung 333

- Strategy Advisor 333
Strike 31
Swing-Trading 257
Synthetischer Call 183
Synthetischer Put 184
Synthetisch Long 185
Systemlaufzeit 197
- T** Tagesrendite 136
Täglicher Abrechnungspreis 124
Teilabsicherung 222, 231
Terminhandel 25
Theta 101
Tradesignal-online 21
Tradingkapital 22
Turbulenter Markt 156
Twin-win-Strategien 196, 252
- U** Uncovered 34
Underlying 31
- V** Vandermart-Tracker 331
Varianz 134
Variation Margin 192f.
Vega 98
- Verfall 32
Verkauf 33
Verkauf einer Kaufoption 37
Verkauf einer Verkaufsoption 41
Verkaufsoption 30
Verlust 34
Verteilungsfunktion 134
Volatilität 79
Volatilitätsfuture 148
Volatilitätsstrategien mit Time-Spreads 288
Vorbildung 21
- W** Wetterderivate 31
Wings 143
- Z** Zeitaufwand 21
Zeitwert 47, 49
Zins 63
Zins-Strategien 196, 217
Zinseinfluss
– amerikanische Call-Option 68
– amerikanische Put-Option 68
– europäische Call-Option 64
– europäische Put-Option 66

