

Manfred Göhl

Einsatzmöglichkeiten von derivaten Instrumenten im Zinsmanagement von Kreditinstituten

Diplomarbeit

Bibliografische Information der Deutschen Nationalbibliothek:

Bibliografische Information der Deutschen Nationalbibliothek: Die Deutsche Bibliothek verzeichnet diese Publikation in der Deutschen Nationalbibliografie; detaillierte bibliografische Daten sind im Internet über <http://dnb.d-nb.de/> abrufbar.

Dieses Werk sowie alle darin enthaltenen einzelnen Beiträge und Abbildungen sind urheberrechtlich geschützt. Jede Verwertung, die nicht ausdrücklich vom Urheberrechtsschutz zugelassen ist, bedarf der vorherigen Zustimmung des Verlags. Das gilt insbesondere für Vervielfältigungen, Bearbeitungen, Übersetzungen, Mikroverfilmungen, Auswertungen durch Datenbanken und für die Einspeicherung und Verarbeitung in elektronische Systeme. Alle Rechte, auch die des auszugsweisen Nachdrucks, der fotomechanischen Wiedergabe (einschließlich Mikrokopie) sowie der Auswertung durch Datenbanken oder ähnliche Einrichtungen, vorbehalten.

Copyright © 2001 Diplom.de
ISBN: 9783832448707

Manfred Göhl

Einsatzmöglichkeiten von derivaten Instrumenten im Zinsmanagement von Kreditinstituten

Manfred Göhl

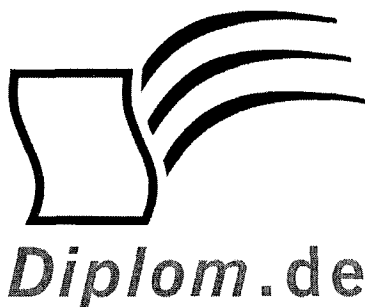
Einsatzmöglichkeiten von derivaten Instrumenten im Zinsmanagement von Kreditinstituten

Diplomarbeit

an der Ostdeutschen Hochschule für Berufstätige Studienzentrum Leipzig

Fachbereich Betriebswirtschaftslehre

Oktober 2001 Abgabe



Diplomica GmbH
Hermannstal 119k
22119 Hamburg

Fon: 040 / 655 99 20
Fax: 040 / 655 99 222

agentur@diplom.de
www.diplom.de

ID 4870

Göhl, Manfred: Einsatzmöglichkeiten von derivaten Instrumenten im Zinsmanagement von Kreditinstituten / Manfred Göhl - Hamburg: Diplomica GmbH, 2002

Zugl.: Leipzig, AKAD - Hochschule für Berufstätige, Diplom, 2001

Dieses Werk ist urheberrechtlich geschützt. Die dadurch begründeten Rechte, insbesondere die der Übersetzung, des Nachdrucks, des Vortrags, der Entnahme von Abbildungen und Tabellen, der Funksendung, der Mikroverfilmung oder der Vervielfältigung auf anderen Wegen und der Speicherung in Datenverarbeitungsanlagen, bleiben, auch bei nur auszugsweiser Verwertung, vorbehalten. Eine Vervielfältigung dieses Werkes oder von Teilen dieses Werkes ist auch im Einzelfall nur in den Grenzen der gesetzlichen Bestimmungen des Urheberrechtsgesetzes der Bundesrepublik Deutschland in der jeweils geltenden Fassung zulässig. Sie ist grundsätzlich vergütungspflichtig. Zuwiderhandlungen unterliegen den Strafbestimmungen des Urheberrechtes.

Die Wiedergabe von Gebrauchsnamen, Handelsnamen, Warenbezeichnungen usw. in diesem Werk berechtigt auch ohne besondere Kennzeichnung nicht zu der Annahme, dass solche Namen im Sinne der Warenzeichen- und Markenschutz-Gesetzgebung als frei zu betrachten wären und daher von jedermann benutzt werden dürften.

Die Informationen in diesem Werk wurden mit Sorgfalt erarbeitet. Dennoch können Fehler nicht vollständig ausgeschlossen werden, und die Diplomarbeiten Agentur, die Autoren oder Übersetzer übernehmen keine juristische Verantwortung oder irgendeine Haftung für evtl. verbliebene fehlerhafte Angaben und deren Folgen.

Diplomica GmbH

<http://www.diplom.de>, Hamburg 2002

Printed in Germany



Wissensquellen gewinnbringend nutzen

Qualität, Praxisrelevanz und Aktualität zeichnen unsere Studien aus. Wir bieten Ihnen im Auftrag unserer Autorinnen und Autoren Wirtschaftsstudien und wissenschaftliche Abschlussarbeiten – Dissertationen, Diplomarbeiten, Masterarbeiten, Staatsexamensarbeiten und Studienarbeiten zum Kauf. Sie wurden an deutschen Universitäten, Fachhochschulen, Akademien oder vergleichbaren Institutionen der Europäischen Union geschrieben. Der Notendurchschnitt liegt bei 1,5.

Wettbewerbsvorteile verschaffen – Vergleichen Sie den Preis unserer Studien mit den Honoraren externer Berater. Um dieses Wissen selbst zusammenzutragen, müssten Sie viel Zeit und Geld aufbringen.

<http://www.diplom.de> bietet Ihnen unser vollständiges Lieferprogramm mit mehreren tausend Studien im Internet. Neben dem Online-Katalog und der Online-Suchmaschine für Ihre Recherche steht Ihnen auch eine Online-Bestellfunktion zur Verfügung. Inhaltliche Zusammenfassungen und Inhaltsverzeichnisse zu jeder Studie sind im Internet einsehbar.

Individueller Service – Gerne senden wir Ihnen auch unseren Papierkatalog zu. Bitte fordern Sie Ihr individuelles Exemplar bei uns an. Für Fragen, Anregungen und individuelle Anfragen stehen wir Ihnen gerne zur Verfügung. Wir freuen uns auf eine gute Zusammenarbeit.

Ihr Team der Diplomarbeiten Agentur

Diplomica GmbH _____
Hermannstal 119k _____
22119 Hamburg _____

Fon: 040 / 655 99 20 _____
Fax: 040 / 655 99 222 _____

agentur@diplom.de _____
www.diplom.de _____

Inhaltsverzeichnis

Inhaltsverzeichnis	I
Abkürzungsverzeichnis	III
Abbildungsverzeichnis	IV
Tabellenverzeichnis	V
Formelverzeichnis	VII
1 Einführung	1
2 Grundlagen	3
2.1 Zinsänderungsrisiken und Zinsmanagement	3
2.2 Derivative Instrumente	8
3 Einsatzmöglichkeiten derivativer Instrumente	11
3.1 Unbedingte Termingeschäfte	11
3.1.1 Zinsswaps	11
3.1.1.1 Definition	11
3.1.1.2 Einsatzmöglichkeiten von Zinsswaps	14
3.1.2 Forward Rate Agreements	28
3.1.2.1 Definition	28
3.1.2.2 Einsatzmöglichkeiten von Forward Rate Agreements	31
3.1.3 Zins-Future	37
3.1.3.1 Definition	37
3.1.3.2 Einsatzmöglichkeiten von Zins-Futures	42

3.2 Bedingte Termingeschäfte	48
3.2.1 Caps, Floors und Collars	48
3.2.1.1 Definition	48
3.2.1.2 Einsatzmöglichkeiten von Caps, Floors und Collars	52
3.2.2 Zinsoptionen	60
3.2.2.1 Definition	60
3.2.2.2 Einsatzmöglichkeiten von Zinsoptionen	62
4 Zusammenfassung und Ausblick	68
Anhang	VIII
Literaturverzeichnis	XVII

Abkürzungsverzeichnis

abzgl.	=	abzüglich
Aufl.	=	Auflage
Bakred	=	Bundesaufsichtsamt für das Kreditwesen
erw.	=	erweiterte
f.	=	folgende
ff.	=	fortfolgende
FRA	=	Forward Rate Agreement
FRA-Satz	=	Forward Rate Agreement-Satz
GuV	=	Gewinn und Verlust
Hrsg.	=	Herausgeber
inkl.	=	inklusive
Mio.	=	Million(en)
Nr.	=	Nummer
S.	=	Seite(n)
überarb.	=	überarbeitete
Verl.	=	Verlag
vgl.	=	vergleiche