

Stichwortverzeichnis

- 2003 Credit Derivatives Definitions 20
- A** Asset Package Delivery 56, 106, 183
 Ausfallintensität 143
 Ausfallrisiko 134, 154, 253
 Ausfallzahlung 176
 Ausfallzeit 142
 Auszahlungsprofil 87
- B** Banca Monte dei Paschi di Siena 187
 Banco Espirito Santo 53, 185
 Banco Popular Español 188
 Bank Recovery and Resolution Directive (BRRD) 63, 276
 Bankruptcy 90, 101
 Barwert 132
 Basel III 39, 70
 Basis-Trading 209
 Bespoke CDO 27
 Big Bang 40
 Black-Formel 156, 158
 Bond 94
 Bond-CDS-Basis 199
 Borrowed Money 94
 Butterfly-Struktur 241
- C** Carry-Flat-Struktur 241
 Carry-Komponenten 246
 CDO² 32
 CDS-Auktion 115
 – Ablauf 120
 – Cash Settlement 125
 – Hintergrund 119
 – Physical Settlement 125
 – Teil 1 121
 – Teil 2 123
 CDS-Bewertung 131, 140
 – Bewertungsformel 136
 – Collateralized CDS 151
 – Standard-ISDA-Modell 146
 CDS-Funktionsweise 81
 CDS-Handelsstrategien 255
 CDS-Index 126, 255
 CDS-Markt
 – Evolution 17
 – Indexuniversum 21
 – jüngere Entwicklungen 59
 – Quotierung 83
 – Regulierung 267
 – Staatsschuldenkrise 42
 – Zukunft 73
 CDS-Option 22, 155
 Cheapest to Deliver 125
 Clearing 39, 281
 CoCo Supplement 57
 Codere 194
 Collateral-Ausfallrisiko 134
 Collateralized CDS 134, 151
 Collateralized Debt Obligation (CDO) 162
 Constant Maturity CDS (CMCDS) 31
 Contingent Convertibles 57, 105
 Corporate CDS 82
 Counterparty-Ausfallrisiko 134, 154
 Coupon 86
 Credit Event 99, 115, 126
 Credit Triangle 30, 147
 Cross-Default 183
- D** Default Leg 17, 131, 139
 Definitionen-Spread 59, 181
 Deliverable Obligations 96
 Delta 23
 Determinations Committee 40, 111
 – Vorgehensweise 113
 – Zusammensetzung 111
 Digital Default Swap (DDS) 30
- E** Ein-Faktor-Copula-Modell 164, 168, 173
 Einlieferbarkeit 183
 EM-Bang 40
 European Market Infrastructure Regulation (EMIR) 66, 280
 Exponentialverteilung 142
- F** Failure to Pay 90, 101
 Financial CDS 82
 Finanzkrise 2007/2008, 34
 Finanzmarktregulierung 268
 Finanztransaktionssteuer 71
 First-to-Default (FtD)-Basket 24
 Fixed Recovery CDS 127
- G** Gamma 24, 177
 Gauß'sches Copula-Modell 166
 Governmental Intervention 56, 93, 104, 106, 182
 Griechische Staatsanleihen 48
- H** Handelbarkeit 97
 Handelsstrategien 199
 Hard Credit Event 100
 Hedge-Ratio 246
 Hedging-Kosten 177
 Hidden-Yield-Methode 206
 HLPGC-Modelle 29
 Hold-to-Maturity-Basis-Trades 208
- I** ICE-Clearing 281
 Index-CDO 27
 Index-CDS, Bewertung 140
 Index-Option 155, 160
 Index-Skew 59, 60
 Index Skew Trade 255
 Intrinsischer Wert 257
 ISDA Credit Derivatives Definitions 19, 52, 88
 ISDA Credit Determinations Committee 18
 ISDA Physical Settlement Matrix 91
 ISDA Transaction Type 89
 Isolux 192

- J** Jump-to-Default-Trading 209
Juristische Risiken 223
- K** Kapitalstrukturstrategien 226
Kontrahentenrisiko 218
Kreditereignis 99
Kündigungsanleihe 216
Kurvenstrategien 240
- L** Leerverkaufsverbot 43, 50, 271
Leerverkaufsverordnung 49
Loan 94
- M** Mark-to-Market-Risiko 252
Markets in Financial Instruments Directive (MiFID) II 68, 285
Marktkonventionen und -standards 81
Master Agreement 18
Moratorium 93, 101
- N** Nachhandelstransparenz 69
Negative Basis 206, 208
New Look 192
No-Cross-Default-Trigger 57
Norske Skog 191
Novation 98
- O** Obligation 93
Obligation Acceleration 93, 100
Obligation Default 100
OLS-Modell 260
Optionen 22
Orphanic CDS 195
Orphanic-Risiko 61
- P** Pair Trades 260
Par Spreads, Umrechnung 145
Premium Leg 17, 131, 137
Prior Deliverable Obligation 56
Private Sector Involvement 47
Protection Leg 131
- Q** Qualifying Guarantee 55, 94
Quanto CDS 44
Quanto-CDS-Spread 175
Quotierung 83
- R** Recovery Default Swap (RDS) 30
Recovery Lock 128
Recovery Rate 87
Recovery Swap 128
Redenominierung 183
Referenzentität 82
Referenzobligation 82
Regulierung
– Basel III 70
– BRRD 63, 276
– EMIR 66, 280
– Institutionen 268
– Leerverkaufsverbot 271
– MiFID II 68, 285
– Solvency II 70
– Zyklus 63
– Zyklus 2008 bis 2018 267
Regulierungsbeginn 39
Repudiation 93, 101
Restructuring 56, 93, 102, 103, 106–108
Restrukturierungen 189
Risiken 252
Risikomanagement 218
Roll-down-Ertrag 243
Rollrisiko 254
- S** Savings & Loan-Krise 17
Short-Selling Ban 49
Single Name CDS 82
Single-Tranche-CDO 26
Skew 24
Small & Big Bang 40
SNS-Bank 53
Soft Credit Event 100
Solvency II 39, 70
Sonderfälle 175
Sovereign CDS 82, 85
Spekulationsinstrument 222
Spekulative Attacke 43
Spread 86
Spread DVO1 149
Spread-Optionen 22
Staatsschuldenkrise 42
Standard-ISDA-Modell 146
Standard Reference Obligation 55, 83
Stochastische Ausfallintensität 145
Strukturierte Kreditderivate 32
Subprimekrise 37
Succession Event 55, 61, 99, 108, 185
Successor Provisions 57
- T** Transaktionsmeldung 69
Trigger 182
- U** Upfront 86, 131
– Settlement 159
– Umrechnung 145
- V** Vega 24
Verwertungsquote 132
Volatilität 23
- W** Währung 85
- Z** Z-Spread-Methode 204
Z*-Spread-Methode 205
Zahlungsströme 87
Zinsrisiko 222