

# SCHRIFTENVERZEICHNIS

## Monographien

- 1993 *Optionsbewertung mit Monte-Carlo-Methoden*, Verlag Josef Eul: Bergisch Gladbach, Köln 1994, zugl. Dissertation Johann Wolfgang Goethe-Universität Frankfurt 1993
- 1999 *Delegation und Kontrakt-Design im Portfolio Management*, Habilitationsschrift, Ludwig-Maximilians-Universität München, Juli 1999, 312 Seiten
- 2005 *Derivative Finanzmarktinstrumente: Eine anwendungsbezogene Einführung in Märkte, Einsatz und Bewertung*, Buchmanuskript, gem. mit Bernd Rudolph, vorauss. März 2005, Springer-Lehrbuch, ca. 470 Seiten

## Buchherausgaben

- 2003 *Taschenbuch der Wirtschaftsinformatik und Wirtschaftsmathematik*, gem. mit Wolfgang König, Helmut Rommelfanger, Dietrich Ohse, Markus Hofmann, Helmut Kuhnle und Andreas Pfeifer, Verlag Harri Deutsch: Frankfurt am Main, Thun. 1. Auflage 1999, 2. Auflage 2003.

## Aufsätze in Zeitschriften und Büchern

- 1989 Semi-Infinite Linear Optimization on Noncompact Spaces and its Application to Approximation Theory, in: *Numerical Functional Analysis and Optimization*, Vol. 10 (1989), No. 5&6, S. 557-572
- 1991 Zur Bewertung von Devisenoptionen: Einfache verteilungsfreie Abschätzungen und exakte Modelle für die Preisbestimmung einer Devisenoption, in: *Wirtschaftswissenschaftliches Studium*, 20. Jg. (1991), Heft 3 (März), S. 122-127
- 1994 Monte Carlo Simulations and the Pricing of Options in the Discontinuous Case, in: *Operations Research '93, Extended Abstracts of the 18th Symposium on Operations Research held at the University of Cologne, September 1-3, 1993*, hrsg. von Achim Bachem, Ulrich Derigs, Michael Jünger und Rainer Schrader, Physica-Verlag: Heidelberg 1994, S. 438-441
- 1995 Einsatz und Bewertung von Optionen und Futures, in: *Derivative Finanzinstrumente*, hrsg. von Bernd Rudolph, Schäffer-Poeschel Verlag: Stuttgart 1995, S. 45-130
- 1996 Exotische Optionen – Systematik und Marktüberblick, gem. mit Marc Rodt, in: *Die Bank – Zeitschrift für Bankpolitik und Bankpraxis*, o. Jg. (1996), Heft 10 (Oktober), S. 602-607
- 1997 Implizite Volatilität, in: *Wirtschaftswissenschaftliches Studium*, 26. Jg. (1997), Heft 6 (Juni), S. 290-294
- Verfahrensalternativen zur Quantifizierung von (Preis-)Risiken, gem. mit Michael Pfennig, in: *Zeitschrift für das gesamte Kreditwesen*, 50. Jg. (1997), Heft 20, S. 1009-1014

- 1998 Portfolio Selection und Schätzfehler bei den erwarteten Renditen: Ergebnisse für den deutschen Aktienmarkt, gem. mit Peter Zimmermann, in: *Finanzmarkt und Portfolio Management*, 12. Jg. (1998), Nr. 2, S. 131-149
- Exotische Optionen: Merkmale, Bewertung und Einsatz, gem. mit Axel F.A. Adam-Müller, in: *Wirtschaftswissenschaftliches Studium*, 27. Jg. (1998), Heft 11 (November), S. 559-564
- Entlohnung von Führungskräften mit Aktienoptionen, in: *Operations Research Proceedings 1997, Selected Papers of the Symposium on Operations Research (SOR 97), Jena, September 3-5, 1997*, hrsg. von Peter Kischka, Hans-Walter Lorenz, Ulrich Derigs, Wolfgang Domschke, Peter Kleinschmidt und Rolf Möhring, Springer-Verlag: Berlin et al. 1998, S. 408-413
- 1999 Preisrisiken bei Commodities – Systematisierung und Implikationen für die Quantifizierung, gem. mit Michael Pfennig, in: *Zeitschrift für Betriebswirtschaft*, Jg. 69 (1999), Nr. 5/6, S. 569-592
- Ausgabe von Aktienoptionen an Arbeitnehmer und deren lohnsteuerliche Behandlung. Erwiderung zu dem Beitrag von Haas/Pötschan, DB 1998, S. 2138, gem. mit Ralph Dautel, in: *Der Betrieb*, 52. Jg. (1999), Heft 16 vom 23.4.1999, S. 823-825
- Stromderivate an internationalen Märkten, gem. mit Marc Rodt, in: *Die Bank – Zeitschrift für Bankpolitik und Bankpraxis*, o. Jg. (1999), Heft 8 (August), S. 548-553
- Preisrisiken in liberalisierten Strommärkten, gem. mit Markus Brummer und Michael Pfennig, in: *Solutions*, 3. Jg. (1999), Heft 3/4 (Winter), S. 7-26
- Kontrakt-Design, Noise Trading und delegiertes Portfolio Management, in: *Managementinstrumente und -konzepte. Entstehung, Verbreitung und Bedeutung für die Betriebswirtschaftslehre*, hrsg. von Anton Egger, Oskar Grün und Reinhard Moser, Schäffer-Poeschel Verlag: Stuttgart 1999, S. 463-480
- Quantifizierung von Commodity-Preisrisiken, gem. mit Michael Pfennig, in: *Elektronische Dienstleistungswirtschaft und Financial Engineering, 2. Internationale FAN-Tagung 1999*, hrsg. von Manfred Steiner, Thomas Dittmar und Christian Willinsky, Münster 1999, S. 153-177
- 2000 Elemente exotischer Optionen in der Ausgestaltung neuerer Aktienoptionsprogramme für Führungskräfte, gem. mit Bernd Rudolph, in: *Das Unternehmen im Spannungsfeld von Planung und Marktkontrolle*, hrsg. von Erich Frese und Herbert Hax, *Zeitschrift für betriebswirtschaftliche Forschung – Sonderheft 44* (2000), S. 39-65
- Spezialfondsregulierung aus ökonomischer Sicht, gem. mit Bernd Rudolph, in: *Handbuch Spezialfonds – Ein praktischer Leitfaden für institutionelle Anleger und Kapitalanlagegesellschaften*, hrsg. von Jochen M. Kleeberg und Christian Schlenger, Uhlenbruch-Verlag: Bad Soden/Ts. 2000, S. 117-139
- 2001 Hedge-Fonds, in: *Handwörterbuch für des Bank- und Finanzwesens*, hrsg. von Wolfgang Gerke und Manfred Steiner, Schäffer-Poeschel Verlag: Stuttgart 2001, 2. Auflage, S. 1005-1015
- Exotic Options, gem. mit Axel F.A. Adam-Müller, in: *Handbuch Corporate Finance – Konzepte, Strategien und Praxiswissen für das moderne Finanzmanagement*, Loseblattwerk, hrsg. von Ann-Kristin Achleitner und Georg F. Thoma, Verlagsgruppe Deutscher Wirtschaftsdienst: Köln.

- 1. Auflage: 7. Ergänzungslieferung – Mai 1998, Kap. 9.6.3., 33 Seiten.
- 2. Auflage 2001, Kapitel 8.4.3, 34 Seiten

Aktienderivate, in: *Handbuch Corporate Finance – Konzepte, Strategien und Praxiswissen für das moderne Finanzmanagement*, Loseblattwerk, hrsg. von Ann-Kristin Achleitner und Georg F. Thoma, Verlagsgruppe Deutscher Wirtschaftsdienst: Köln.

- 1. Auflage: 8. Ergänzungslieferung – Juli 1998, Kap. 9.5., 106 Seiten.
- 2. Auflage 2001, Kapitel 8.3.1, 98 Seiten

Hedge-Fonds, in: *Handbuch Corporate Finance – Konzepte, Strategien und Praxiswissen für das moderne Finanzmanagement*, Loseblattwerk, hrsg. von Ann-Kristin Achleitner und Georg F. Thoma, Verlagsgruppe Deutscher Wirtschaftsdienst: Köln.

- 1. Auflage Ergänzungslieferung – Juli 2000, Kap. 5.1.10, 42 Seiten.
- 2. Auflage 2001, Kapitel 7.1.4, 43 Seiten

Warenderivate, gem. mit Marc Rodt, in: *Handbuch Corporate Finance – Konzepte, Strategien und Praxiswissen für das moderne Finanzmanagement*, Loseblattwerk, hrsg. von Ann-Kristin Achleitner und Georg F. Thoma, Verlagsgruppe Deutscher Wirtschaftsdienst: Köln 2001, 2. Auflage, Kapitel 8.4.4, 53 Seiten.

In der 1. Auflage bestehend aus zwei Beiträgen:

- Überblick zu Waren und Warenderivaten, Oktober 2000, Kap. 9.6.4.1, 12 Seiten
- Elektrizitätsderivate, Oktober 2000, Kap. 9.6.4.2, 45 Seiten

- 2003 Promovarea și cercetarea publică A Înființării de întreprinderi în Germania (in rumänisch), gem. mit Mavie Schäfer, in: *Journal of the American-Romanian-Academy of Arts & Sciences*, Volume 2003, No. 28, p. 108-112

Quantitative Methoden des modernen Wertpapier-Management, in: *Taschenbuch der Wirtschaftsinformatik und Wirtschaftsmathematik*, hrsg. von Wolfgang König, Helmut Rommelfanger, Dietrich Ohse, Markus Hofmann, Klaus Schäfer, Helmut Kuhnle und Andreas Pfeifer, Verlag Harri Deutsch: Frankfurt am Main, Thun.

- 1. Auflage 1999, S. 210-240
- 2. Auflage 2003, S. 377-409

## Rezensionen

- 1991 Buchbesprechung zu Casal, Christian, Die Problematik mittelfristiger Wechselkurschwankungen für international tätige Unternehmen, in: *Zeitschrift für Wirtschafts- und Sozialwissenschaften*, 11. Jg. (1991), Heft 4, S. 641-644
- 1995 Buchbesprechung zu Berendes, Christian, Analyse der Preiskomponenten von Anleihe-Futures, in: *Zeitschrift für Betriebswirtschaft*, 65. Jg. (1995), Heft 11, S. 1324-1326
- 2000 Buchbesprechung zu Korn, Ralf / Korn, Elke, Optionsbewertung und Portfolio-Optimierung, in: *OR News*, Juli 2000, Nr. 9, S. 43-44  
 Buchbesprechung zu Seydel, Rüdiger, Einführung in die numerische Berechnung von Finanz-Derivaten. Computational Finance, in: *OR News*, November 2000, Nr. 10, S. 40-41.
- 2002 Buchbesprechung zu Kohlmann, Michael / Tang, Shanjian (Hrsg.), *Mathematical Finance*, in: *OR News*, November 2002, Nr. 16, S. 42

## Weiteres

- 1997 Kapitalmarktforschung an der Münchner Universität, gem. mit Bernd Rudolph, in: *Die Bank – Zeitschrift für Bankpolitik und Bankpraxis*, o. Jg. (1997), Heft 1 (Januar), S. 58-59
- 1997 Argumentationsskizzen in der Diskussion um die Entlohnung von Führungskräften mit Aktienoptionen, Arbeitspapier, Seminar für Kapitalmarktforschung und Finanzierung, Ludwig-Maximilians-Universität München, August 1997, 26 Seiten
- 1999 Preisrisiken in liberalisierten Strommärkten, gem. mit Markus Brummer und Michael Pfennig, zusammenfassende Ankündigung in: *Die Betriebswirtschaft*, DBW-Depot, 59. Jg. (1999), Nr. 6, S. 841-842
- 2000 Comment zu Manfred Kremer, Politikoptionen zur Begrenzung von Hedge-Fonds-Risiken, in: *Risikomanagement an internationalen Finanzmärkten*, hrsg. von Christian A. Conrad und Markus Stahl, Schäffer-Poeschel Verlag: Stuttgart 2000, S. 238-240
- 2001 Die Komponenten des Risikos von Warenpreisänderungen, gem. mit Dietmar Franzen, in: *TreasuryLog*, o. Jg. (2001), Heft 2, S. 4-7
- 2003 Basel II: Eigenkapital für den Mittelstand, gem. mit Hubert Dechant, Arbeitspapier, Kufsteiner Hefte 03-02, FHS-KufsteinTirol, Februar 2003, 24 Seiten  
(Öffentliche) Gründungsförderung und Gründungsforschung in Deutschland, Arbeitspapier 2003, 10 Seiten

## Skripten

- Finanztermingeschäfte und Optionspreistheorie: Märkte, Strategien und Bewertungstheorien*, Studienbegleitendes Skriptum, Ludwig-Maximilians-Universität München, 3. Auflage 1996, 297 Seiten; 4. Auflage 1997, 327 Seiten; 5. Auflage 1998, 376 Seiten; 6. Auflage 1999, 403 Seiten
- Portfolio Management*, Studienbegleitendes Skriptum, gem. mit Markus Prüher, Ludwig-Maximilians-Universität München, 1. Auflage 1997, 136 Seiten; 2. Auflage 1998, 157 Seiten
- Investitionsplanung*, Studienbegleitendes Skriptum, Universität zu Köln, SoSe 2002, 336 Seiten
- Investition und Finanzierung*, Studienbegleitendes Skriptum, TU Bergakademie Freiberg, WS 2004-05, 148 Seiten