

## 2001

**01-01 Thomas Kraus und Thomas Pfiffner**

„Preisbildung im Schweizer Warrantsmarkt und an der EUREX-  
Ein empirischer Vergleich“, Februar 2001  
(CHF 5.10)

**01-02 Manuel Ammann und Silvan Herriger**

„Relative Implied Volatility Arbitrage with Index Options :  
Another Look at Market Efficiency“, Februar 2001  
(CHF 7.80)

**01-03 Andreas Grünbichler und Alfred Gruber**

„Electronic Communication Networks im Vormarsch ?“  
Treasury Log Nr. 1/2001, S. 20 – 22  
(CHF --.60)

**01-04 Manuel Ammann, Axel H. Kind und Christian Wilde**

„Are Convertible Bonds Underpriced ?“  
An Analysis of the French Market, Feb. 2001  
(CHF 7.20)

**01-05 Manuel Ammann und Christian Reich**

„Value-at-Risk for Nonlinear Financial Instruments“  
März 2001  
(CHF 7.50)

**01-06 Manuel Ammann, Dean Jovic und Christian Schmid**

„Diskriminierte regionale Institute“  
Schweizer Bank 4/2001, S. 18-20  
(CHF --.90)

**01-07 Manuel Ammann und Heinz Zimmermann**

„The credit model risk of interest rate derivatives and regulatory implications“  
Derivatives Use, Trading & Regulation Volume Six, Nr. 3/2000, S. 217 – 229  
(CHF 3.90)

**01-08 Manuel Ammann and Heinz Zimmermann**

„Tracking Error and Tactical Asset Allocation“,  
Financial Analysts Journal Vol. 57, No. 2, März/April 2001, S. 32-43  
(CHF 3.60)

**01-09 Manuel Ammann, Dean Jovic, Christian Schmid**

„Der ‚IRB-Ansatz‘ als strategische Herausforderung für Banken“,  
Konsultativpapiers „New Basel Capital Accord“, Januar 2001,  
(CHF 3.00)

**01-10 Michael Bauer, Stéphanie Bilo, Heinz Zimmermann**

„Publicly traded Private Equity : An Empirical Investigation“,  
Second Draft 1,  
(CHF 8.10)

**01-11 Andreas Grünbichler**

„Irrationale Übertreibungen : Zum Zustand der Aktienmärkte“  
Bank Archiv, September 2001, S. 669-670  
(CHF --.60)

**01-12 Manuel Ammann**

“Do Risk-Adjusted Pricing and the New Basel Capital Accord Reinforce the Credit  
Cycle?”, Financial Markets and Portfolio Management 15(2), 2001.  
(CHF 2.10)

**01-13 Manuel Amman, Christian Reich**

“VaR for Nonlinear Financial Assets: Linear Approximation or full Monte Carlo?”,  
Financial Markets and Portfolio Management 15(3), 2001  
(CHF 4.80)

**01-14 Manuel Ammann, Dean Jovic, Christian Schmid**

„Der IRB-Ansatz als strategische Herausforderung für Banken“, Schweizer Treuhänder,  
10/2001  
(CHF 2.10)