

Inhaltsverzeichnis

Geleitwort	V
Vorwort der Herausgeber	VI
Die Herausgeber	VII
Teil I:	
Rahmenbedingungen im Risikomanagement	1
<i>Roland van Gisteren</i>	
Bankrisikosteuerung im Wandel – Paradigmenwechsel für das Personalmanagement	3
<i>Frank Rust</i>	
Einführung von Zinsmanagementprodukten	21
Teil II:	
Zinskurven als Basis für ein modernes Risikomanagement	55
<i>Walter Gruber</i>	
Generierung von Zins-, Volatilitäts- und Ausfallstrukturkurven	57
<i>Frank Brüggemann/Stefan Klose</i>	
Modellierung von Zinskurven in der Praxis	83
<i>Peter Oellers</i>	
Überblick über Zinsstrukturmodelle und deren Einsatz im Risiko-Management	105
Teil III:	
Value-at-Risk und mehr	127
<i>Stefan Reitz</i>	
Vergleich verschiedener Value-at-Risk Ansätze	129
<i>Mark W. Beinker/Hans-Peter Deutsch</i>	
Die drei Hauptmethoden zur VaR – Berechnung im Praxisvergleich	153

<i>Thomas Siegl/Ansgar West/Markus von Rothkirch/Hans-Peter Deutsch</i> Erweiterung der Delta-Normal VaR-Methode um nichtlineare Risiken – der Dynamic-Hedge	173
<i>Martin Breitenbücher/Joachim Kretschmer</i> Theorie und Methodik der Szenario Simulation	203
<i>Peter Reichling</i> Risikomessung durch Volatilität, Value-at-Risk oder Lower-Partial-Moment ..	223
<i>Michael Claus Röhl</i> GARCH-Modelle im Risikomanagement	239
Teil IV: Stresstesting und Backtesting	265
<i>Thomas Alm/Gisela Maercker</i> Stress-Szenarien für extreme Marktveränderungen	267
<i>Marc Krämer/Hansjörg Schmidt</i> Konsistentes Backtesting – ein Vergleich verschiedener Verfahren	287
<i>Ludger Overbeck/Oliver Zakrzewski</i> Der Q-Test von J.P. Morgan – Inhalt, Aussagekraft und Grenzen	329
Teil V: Gesamtbanksteuerung und Performancemessung	341
<i>Christian Göckenjan/Albrecht Holderrieth/Gordon Seiffart</i> Anforderungen an ein Risikomodell zur Gesamtbanksteuerung und dessen softwaretechnische Umsetzung	343
<i>Reimund Belz/Matthias Schneider</i> Integrierte Analyse von Performance und Risiko verschiedener Anlage- strategien anhand historischer Wertentwicklungen	363
<i>Christoph Burmester/Christian T. Hille/Hans-Peter Deutsch</i> Risikoadjustierte Kapitalallokation: Beurteilung von Allokationsstrategien über einen Optimierungsansatz	389
Teil VI: Grundsatz I, Aufsichtsrechtliche Anforderungen an das Risikocontrolling	419

<i>Michael Feucht/Max Weber</i> Standardverfahren im neuen Grundsatz I	421
<i>Petra Schlüter/Cornelia Stratenwerth</i> Berechnung der Grundsatz I – Eigenmittelunterlegung am Beispiel eines Musterportfolios	463
<i>Michael Feucht</i> Quantitative und qualitative Anforderungen an interne Risikomodelle	507
<i>Steffen Lenzian</i> Procedere einer Modelleprüfung	529
<i>Dirk Wohler</i> Mindestanforderungen an das Betreiben von Handelsgeschäften der Kreditinstitute	551
<i>Franz Weber</i> Der Verfahrensablauf von Handelsgeschäftsprüfungen durch die Landeszentralbanken	567
<i>Peter Spicka</i> Bankenaufsicht in globalisierten Finanzmärkten	581
<i>Michael Ritter</i> BCCI-Folgerichtlinie und die institutionelle Gestaltung der grenzüber- schreitenden Bankenaufsicht	593
Stichwortverzeichnis	625