

Inhaltsverzeichnis

Vorwort zur zweiten Auflage.....	V
Vorwort zur ersten Auflage.....	VII
Autorenverzeichnis	XIII

I Neue Märkte für Kreditrisiken

1	X Kreditrisiken und Kreditmärkte	3
	<i>Hans-Peter Burghof, Stephan Paul, Bernd Rudolph</i>	
2	Entwicklungslinien des Marktes für Kreditderivate	31
	<i>Hans-Peter Burghof, Sabine Henke</i>	

II Produkte zum Transfer von Kreditrisiken

1	X Grundformen von Kreditderivaten.....	55
	<i>Christian Neske</i>	
2	Exotische Kreditderivate.....	71
	<i>Achim Posthaus</i>	
3	Collateralized Loan Obligations (CLOs).....	87
	<i>Markus Herrmann</i>	
4	Alternative Produkte des Kreditrisikotransfers.....	105
	<i>Hans-Peter Burghof, Sabine Henke</i>	

III Der Markt für Kreditderivate

- 1 Marktstruktur, Handelsplätze und Marktteilnehmer 123
Claus Dülfer
- 2 Kreditderivate im deutschen Finanzmarkt – Empirische Ergebnisse 149
Christian Brütting, Hans-Peter Burghof, Sabine Henke, Antje Schirm, Nicolas Weber

IV Institutionelle Rahmenbedingungen des Einsatzes von Kreditderivaten

- 1 Zivilrechtliche Einordnung von Kreditderivaten 183
Hans-Günther Nordhues, Marc Benzler
- 2 Vertragsdokumentation und Standardisierung 217
Hans-Günther Nordhues, Marc Benzler
- 3 Bilanzierung von Kreditderivaten nach HGB 237
Dirk Auerbach, Götz-Eric Fischer
- 4 Bilanzierung von Kreditderivaten nach IFRS 261
Dirk Auerbach, Daniela Klotzbach
- 5 Steuerliche Behandlung von Kreditderivaten 277
Hans-Jürgen A. Feyerabend, Andreas Patzner, Brigitta Kieninger

V Einsatzfelder für Kreditderivate

- 1 Risikomanagement mit Kreditderivaten 309
Günter Franke
- 2 Einsatz von Kreditderivaten zum Zwecke der Eigenmitteloptimierung 331
Hermann Watzinger
- 3 Financial Engineering mit Kreditderivaten 347
Petra Schwab
- 4 Kreditderivate im Risikocontrolling der Kreditinstitute 363
Volker Gehrman

5	Basket-Kreditderivate und Collateralized Debt Obligations als Instrumente des Portfoliomanagements.....	391
	<i>Christian Bluhm, Walter Mussil</i>	
6	Einsatz von Kreditderivaten im Risikomanagement von Industrieunternehmen.....	411
	<i>Ralf Lierow</i>	

VI Bankbetriebliche Fragestellungen beim Einsatz von Kreditderivaten

1	Organisation des Handels und Fragen des Risikomanagements aus Sicht der internen Revision.....	429
	<i>Axel Becker, Martin Wolf</i>	
2	Kreditrisikomodelle und der Einsatz von Kreditderivaten	463
	<i>Susanne Niethen, Mark Wahrenburg</i>	
3	Bedingungen für die Handelbarkeit von Buchkrediten	485
	<i>Thomas Hartmann-Wendels</i>	
4	Anforderungen an die Datenverarbeitung bei Einführung von Kredit- derivaten und Durchführung von Securitization-Transaktionen.....	505
	<i>Claudia Max-Heine, Jürgen Häcker</i>	

VII Kreditderivate und Aufsichtsrecht

1	Bankaufsichtliche Behandlung von Kreditderivaten in Deutschland	537
	<i>Hermann Schulte-Mattler, Dorothea Meyer-Ramloch</i>	
2	Risikomanagement von Kreditderivaten vor neuen regulatorischen Herausforderungen	573
	<i>Christian Brütting</i>	
3	Der Einsatz von Kreditderivaten bei richtlinienkonformen Sondervermögen nach dem Investmentgesetz	597
	<i>Tilmann Roth</i>	

VIII Bewertung von Kreditderivaten

1	Bewertungsmodelle für Ausfallrisiken: Eine Literaturübersicht	619
	<i>Lutz Schlögl</i>	
2	Die Implementierung von Intensitätsmodellen	639
	<i>Philipp J. Schönbucher, Daniel Sommer</i>	
3	Kreditrisikomodelle zur Bewertung von Kreditderivaten.....	661
	<i>Philipp J. Schönbucher</i>	
4	Bewertung von Basket-Kreditderivaten und Collateralized Loan Obligations	715
	<i>Frank Lehrbass</i>	
5	Abhängigkeitsmodellierung mit transformierten Austrittszeiten.....	739
	<i>Ludger Overbeck, Wolfgang M. Schmidt.</i>	
6	Quantitative Analyse von Cash Sale Collateralized Bond Obligations (Cash Sale CBOs)	751
	<i>Bernd Schmid, Anna Kalemanova</i>	
	Glossar Kreditderivate	767
	Literaturverzeichnis	781
	Verzeichnis der Rechtsquellen und Kommentare.....	813
	Stichwortverzeichnis	823