

Inhalt

Erstes Vorwort	7
Zweites Vorwort	9
1 Risikomodellierung und Extremwerttheorie	15
2 Verteilungen zur Modellierung von Finanzmarktzeitreihen	35
3 Bedingte Volatilitätsmodellierung	45
4 Konzepte und Maße zur Erfassung von Zusammenhängen zwischen den Risikofaktoren	61
5 Das Copula-Konzept	73
6 Alternative Risikomaße im Portfoliokontext	87
7 Das Copula-GARCH-Verfahren	97
Anhang	111
Abbildungsverzeichnis	112
Tabellenverzeichnis	114
Literaturverzeichnis	115
Der Autor	120
Unternehmensporträt	121