

# Inhaltsverzeichnis

Vorwort.....	V.
Autoren und Herausgeber.....	IX
<i>Dirk Talkenberger/Carsten S. Wehn</i>	
Kontrahentenrisiko im Überblick.....	1
<i>Mark Beinker/Matthias Föhl</i>	
Praxisorientierte Steuerung von Kontrahentenrisiken .....	21
<i>Franz Ackermann/Wolfgang Putschögl/Marlene Wickenhauser</i>	
Methodische Umsetzung der Berechnung des Kontrahentenrisikos und des Credit-Valuation-Adjustments in der Praxis.....	39
<i>Klaus Böcker/Bernd Schröder</i>	
Die Reduzierung von Kontrahentenrisiken durch Collateral Management .....	61
<i>Stefan Reitz/Ronny Hahn</i>	
Ansätze zur EaD-Schätzung .....	97
<i>Manfred Plank/Sven Ludwig</i>	
Credit-Valuation-Adjustments – eine kurze mathematische Einführung und ein praktischer Überblick .....	113
<i>Christian Bree/Ansgar Linder/Mario Schlener</i>	
Einsatz von Derivaten zum Hedging .....	125
<i>Stefan Blochwitz/Marcus R. W. Martin</i>	
Stresstests für Kontrahentenexposures und Credit-Valuation-Adjustments.....	151
<i>Christian Bree/Ansgar Linder</i>	
Semianalytische Approximation des Credit-Valuation-Adjustments.....	171
<i>Jörg Kienitz/Horst Küpker</i>	
Risikomanagement – Monte-Carlo-Methoden für Nicht-Gaußsche Verteilungen .....	189
<i>Sascha E. Engelbrecht/Sven Ludwig</i>	
Technische Umsetzung einer integrierten Kontrahentenrisiko-Plattform.....	211
<i>Thomas Nagel</i>	
Counterparty-Credit-Risk im neuen regulatorischen Rahmenwerk von Basel III.....	249
<i>Hansjörg Schmidt</i>	
Basel III und CVA aus regulatorischer Sicht .....	267

<i>Daniel Schwake/Thomas Siwik/Dirk Stemmer</i> Kontrahentenausfallrisiken in Rechnungslegung und Aufsichtsrecht.....	289
<i>Sascha E. Engelbrecht/Andreas Reif</i> Standardregulierung und Interne-Modelle-Methoden (IMM) .....	313
<i>David M. Rowe</i> Epilog: Ansichten zum Credit-Valuation-Adjustment .....	341
Glossar.....	345
Stichwortverzeichnis.....	353