

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	3
Geleitwort	7
Grundsätzliche Aspekte des Modellrisikos <i>Peter Quell</i>	15
Mindestanforderungen an die Validierung von Risikomodellen <i>Ottmar Bongers</i>	33
Übergreifendes Modellrisikomanagement <i>Jan-Philipp Hoffmann</i>	65
Effektive Prozesse zur Modellvalidierung bei einer Vielzahl von Sondervermögen <i>Martin Grottko, Christian Hörhammer, Andreas Keese</i>	87
Validierung von Rating-Verfahren <i>Hubert Eckelmann</i>	107
Validierung von Kreditportfoliomodellen <i>Frank Beekmann, Radoslava Mirkov, Holger Thomae</i>	133

Modellierung und Validierung der Incremental Risk Charge <i>Rainer Int-Veen, Peter Martens, Thomas Schulze</i>	159
Validierung eines Marktrisikomodells <i>Thorsten Herrmann, Bernd Amendinger</i>	181
Risikoinventur im Marktrisikomodell <i>Christoph Hofmann, Carsten S. Wehn</i>	215
Validierung integrierter Markt- und Kredit-Risikomodelle <i>Marius Bochniak</i>	237
Modellrisiken und Validierung in Zusammenhang mit Kontrahentenrisiko <i>Marlene Wickenhauser</i>	251
Validierung von Modellen zur Quantifizierung operationeller Risiken <i>Andreas Peter</i>	273
Validierung des Liquiditätsrisikos aus Kundenverhalten <i>Thomas Maul, Radoslava Mirkov, Holger Thomae</i>	303
Validierung im Asset Liability Management <i>Oliver Hein, Christian Salm</i>	327

Aspekte der Validierung durch Stresstests und des Trading Book Reviews	347
<i>Marcus R. W. Martin</i>	
Über die Herausgeber und Autoren	358
Stichwortverzeichnis	366