

Inhaltsverzeichnis

Vorwort	V
1. Einleitung	1
2. Einstieg	5
2.1. Der Begriff Risiko.....	5
2.2. Risikokategorien und Gesamtbankrisiko.....	12
2.3. Finanzmärkte.....	25
2.4. Bankenaufsicht.....	36
2.5. Grundsätze des Risikomanagements	48
3. Marktrisiko	57
3.1. Value-at-Risk (VaR).....	57
3.2. Volatilitäten, Korrelationen.....	71
3.3. Bewertung von Finanzinstrumenten.....	83
3.4. Optionen.....	96
3.5. Stress-Test.....	113
3.6. Internes Modell.....	122
3.7. Limitsysteme und Risikoberichte	132
4. Hedge-Funds	143
5. Asset-Liability-Management	157
6. Finanzinvestoren und Marktrisiko	175
7. Konkurrenzvergleich	181
8. Schlussbemerkungen	185
9. Bibliographie.....	187
10. Antworten und Lösungen.....	189
Kapitel „Der Begriff Risiko“	189
Kapitel „Risikokategorien und Gesamtbankrisiko“	191
Kapitel „Finanzmärkte“	192
Kapitel „Bankenaufsicht“	195
Kapitel „Grundsätze des Risikomanagements“	198
Kapitel „Value-at-Risk“	199
Kapitel „Volatilitäten, Korrelationen“	202
Kapitel „Bewertungen von Finanzinstrumenten“	205
Kapitel „Optionen“	210
Kapitel „Stress-Test“	218
Kapitel „Internes Modell“	219
Kapitel „Limitsysteme und Risikoberichte“	221
Kapitel „Hedge-Funds“	224
Kapitel „Asset-Liability-Management“	226
11. ABC-Glossar.....	233
Stichwortverzeichnis	261