

Lutz Johanning / Bernd Rudolph

Handbuch Risikomanagement

Risikomanagement für Markt-, Kredit- und
operative Risiken

Inhalt

Band 1: „Risikomanagement für Markt-, Kredit- und operative Risiken“

I. Grundlagen des Risikomanagements

Risikomanagement für Kreditwirtschaft und Finanzmärkte.....	5
<i>Franz-Christoph Zeitler</i>	
Entwicklungslinien im Risikomanagement.....	15
<i>Bernd Rudolph / Lutz Johanning</i>	
Gefahren kurzfristigen Risikomanagements durch Value-at-Risk.....	53
<i>Günter Franke</i>	
ArmutsmäÙe als Downside-RisikomäÙe: Ein Weg zu RisikomäÙen, die dem Value-at-Risk überlegen sind.....	85
<i>Andreas Pfingsten / Carsten Breitmeyer / Frank Eggers / Hendrik Hakenes / Christoph Rechten / Sven Ries</i>	

II. Risikomanagement für Marktrisiken

Finanzinstrumente und ihre Bewertung: Eine Darstellung der wichtigsten Finanz-instrumente des Marktrisikobereiches und ihrer theoretischen Bewertungsverfahren.....	111
<i>Maximilian Hogger / Christoph Kesy</i>	
LIBOR-Marktmodelle.....	151
<i>Morten Bjerregaard Pedersen / Alexandra Schumacher</i>	
Verfahren zur Value-at-Risk-Berechnung im Marktrisikobereich.....	181
<i>Stefan Haschens</i>	

Extremwerttheorie für Finanzzeitreihen - ein unverzichtbares Werkzeug im Risikomanagement.....	219
<i>Milan Borkovec / Claudia Klüppelberg</i>	
Spezifisches Risiko für Unternehmensanleihen.....	245
<i>Ulrich Anders /Ludger Overbeck</i>	
Flexibles oder starres Cashflow-Mapping ?.....	269
<i>Thomas Ridder / Gerhard Stahl</i>	
Backtesting: Allgemeine Theorie, Praxis und Perspektiven.....	289
<i>Ludger Overbeck / Gerhard Stahl</i>	
Risikomanagement und Bilanzierung von Financial Instruments: Anmerkungen zu einem gespannten Verhältnis.....	321
<i>Thomas K. Naumann</i>	

III. Risikomanagement für Kreditrisiken

Perspektiven des Einsatzes von Produkten des Kreditrisikomanagements auf Bankkredite.....	351
<i>Hans-Peter Burghof/ Sabine Henke</i>	
Trends im Kreditrisikomanagement.....	377
<i>Thomas C. Wilson</i>	
Credit Risk Management & Trading: Motivation und Zielsetzung mit Blick auf die Bewertung von Kreditrisiken aus Handelsgeschäften.....	407
<i>Hans-Jürgen Brasch / Dirk Jens F Nonnenmacher</i>	
Quantitative Verfahren zur Unternehmensklassifikation - eine vergleichende Analyse.....	433
<i>Thomas Dittmar / Manfred Steiner</i>	

Statistische Modelle im Kreditgeschäft der Banken.....	459
<i>Alfred Hamerle</i>	"
Portfolioeffekte bei der Kreditrisikomodellierung.....	491
<i>Mark Wahrenburg / Susanne Niethen</i>	
Integration von Rückzahlungsquoten in die Bepreisung von Krediten.....	525
<i>Bernd Rolfes / Frank Broker</i>	
Modellierung von Sicherheiten im Kreditrisikomanagement.....	551
<i>Martin Gonzenbach / Gert-Jan Hiisman / Axel Müller-Groeling / Ralf Goebel</i>	
Die Quantifizierung von Länderrisiken mit Hilfe von Kapitalmarktspreads.....	579
<i>Tanja Dresel</i>	
Kapitalmarktbasierter Portfolioanalyse von Länderrisiken - Ein struktureller No-Arbitrage Ansatz.....	611
<i>Frank Lehrbass</i>	
IV. Risikomanagement für operative Risiken	
Quantifizierung von Operational Risk mit Value-at-Risk.....	633
<i>Helmut Beeck / Thomas Kaiser</i>	(
Management operationeller Risiken bei Finanzdienstleistungen.....	655
<i>Andreas Peter / Hans-Jürgen Vogt / Volker Kraß</i>	
Stichwortverzeichnis.....	XV

Band 2: "Risikomanagement in Banken, Asset Management-Gesellschaften, Versicherungs- und Industrieunternehmen"

V. Risikomanagement in Banken

Zur strategischen Bedeutung des Risikomanagements für die Kreditinstitute.....	683
<i>Jürgen Krumnow</i>	
Risikomanagement im derivativen Geschäft.....	701
<i>Wolfgang F. Walther</i>	
Modellrisiko bei der Value-at-Risk-Berechnung für DAX-Optionen.....	729
<i>Lutz Johanning /Franziska Ernst</i>	
Internationale bankaufsichtliche Eigenkapitalstandards für Kreditinstitute.....	75,5
<i>Edgar Meister /Reinhold Vollbracht / Jürgen Baum</i>	
Bankaufsichtliche Prüfung und Zulassung interner Marktrisikomodelle.....	775
<i>Uwe Traber</i>	
Die Hyperfläche© - Dynamische Risikobetrachtung mittels mehrdimensionaler Sensitivitätsanalyse.....	797
<i>Matthias Bode / Michael Mohr</i>	
Dynamische Limitsetzung.....	833
<i>Hermann Locarek-Junge /Mario Straßberger /Henning Vollbehr</i>	
Shareholder-Value-gerechte Abbildung von Risiken im Wertebereich bei Banken als Basis eines Risk-Return-Controlling.....	851
<i>Carsten Prussog / Thomas Günther</i>	
Konzepte zur Risiko-Ertragssteuerung in Kreditinstituten.....	879
<i>Neal Stoughton / Josef Zechner</i>	

Risikomanagement und Ressourcensteuerung	903
<i>Reinhard Kutscher /Albrecht Hartmann</i>	

Implementierung der Risikomessung und -Steuerung in einer divisional strukturierten Bank	919
<i>Michael Brockmann /Rainer Danschke / Thomas M. Dewner</i>	

VI. Risikomanagement im Asset Management

Portfoliosteuerung bei beschränktem Verlustrisiko	941
<i>Gerhard Scheuenstuhl / Rudi Zagst</i>	

Value-at-Risk im Asset Management	973
<i>Jochen M. Kleeberg / Christian Schienger</i>	

Dynamische Asset AUocation mit langfristigem Value-at-Risk	1015
<i>Herold C. Rohweder</i> • •	

VII. Risikomanagement im Versicherungsbereich

Risikocontrolling im Bereich der Kapitalanlagen einer globalen Versicherungsgruppe	1051
<i>Alfred Baldes / Volker Deville</i>	

Integriertes Risikomanagement für die Versicherungsbranche - Ein gesamtheitlicher Ansatz zur effizienteren Deckung von Risiken	1073
<i>Andreas Müller</i>	

Value-at-Risk für Versicherungsunternehmen: Konzeptionelle Grundlagen und Anwendungen	1105
<i>Peter Albrecht / Sven Koryciorz</i>	

Risikomanagement und Unternehmenswert von Versicherungen:	
Die Wertrelevanz der Kapitalanlage.....:	1131
<i>Frank-Christian Corell</i>	

VIII. Risikomanagement in Industrieunternehmen

Rollierende Absicherung langfristiger Lieferverpflichtungen - Hat die Metallgesellschaft ihre Positionen zu früh aufgelöst?.....	1175
<i>Wolfgang Bühler / Olaf Korn</i>	
!>	
Preisbildung auf liberalisierten Strommärkten.....	1213
<i>Ralf Wagner / Michael Schroeder /Niels Ellwanger</i>	
Value-at-Risk für Rohstoffpreisrisiken.....	1239
<i>Matthias Kropp /Dirk Schubert</i>	
Verfahren zur Schätzung finanzwirtschaftlicher Exposures von Nichtbanken. . .	1267
<i>Söhnke M. Bartram</i>	
Shareholder Value durch unternehmensweites Risikomanagement.....	1295
<i>Michael Pfennig</i>	
Berücksichtigung von Risikoaspekten im EVA® Management- und Vergütungssystem.....:	133 5
<i>Matthias-Wilbur Weber /Maximilian Koch</i>	
Autorenverzeichnis.....:	XV
Stichwortverzeichnis.....	XLV