

Andreas Oehler (Hrsg.)

# Kreditrisikomanagement

Kernbereiche, Aufsicht  
und Entwicklungstendenzen

2., überarbeitete und erheblich  
erweiterte Auflage

2002

Schaffer-Poeschel Verlag Stuttgart

# Inhaltsverzeichnis

Vorwort zur 2. Auflage.....	V
Autorenverzeichnis.....	IX
<i>Jochen Flach / Heinrich Rommelfanger</i>	
Fuzzy-Logik-basiertes Bonitatsrating.....	1
<i>Marliese Uhrig-Homburg</i>	
Zinsstrukturkurven unterschiedlicher Risikoklassen.....	35
<i>Helmut Zink</i>	
Quantifizierung des Risikos von Finanzmarktkrisen im Kreditrisikomanagement von Banken.....	59
<i>Stefan Huschens / Hermann Locarek-Junge</i>	
Konzeptionelle und statistische Grundlagen der portfolioorientierten Kreditrisikomessung.....	89
<i>Jorn Barth</i>	
Worst-Case Analysen des Ausfallrisikos eines Portfolios aus marktabhängigen Finanzderivaten.....	115
<i>Volker Lager / Andreas Oehler</i>	
Bewertung von Kreditderivaten mit Gegenparteirisiko.....	157
<i>Wolfgang Bu'hler / Christoph Engel / Olaf Korn / Gerhard Stahl</i>	
Backtesting von Kreditrisikomodellen.....	181
<i>Gerhard Stahl / Uwe Traber / Thomas Dietz</i>	
Backtesting in Action.....	219
<i>Karl Diirselen</i>	
Institutseigene Risikomodelle unter aufsichtsrechtlichen Aspekten.....	243
<i>•Stefan Huschens / Konstantin Vogl</i>	
Kreditrisikomodellierung im IRB-Ansatz von Basel II.....	279

*Katja Pluto*

Basel II - Ein Weg zur bankaufsichtlichen Anerkennung von Kreditrisikomodellen?.....	297
Literaturverzeichnis.....	323
Stichwortverzeichnis.....	337