

Risikomanagement aus Bankenperspektive – Grundlagen, mathematische Konzepte und Anwendungsfelder

Thomas Burkhardt, Andreas Knabe,
Karl Lohmann, Ursula Walther (Hrsg.)

Inhaltsverzeichnis vom 11.04.2005

Inhalt

Vorwort	5
1 Grundlagen	9
<i>Martin Bouzaima, Thomas Burkhardt</i>	
Das Erwartungsnutzenprinzip mit Zielerreichungszeit als Zufallsvariable	11
<i>Steffen G. Meusel, Sebastian Aschenbrenner-von Dahlen</i>	
Basel II und Solvency II – Überlegungen zu einem einheitlichen Aufsichtsrahmen bezüglich der Risiken bei Banken und Versicherern	35
<i>Silvia Rogler</i>	
Möglichkeiten der Erfassung und Identifizierbarkeit industrieller Risiken im Jahresabschluß und Lagebericht	65
<i>Andreas Knabe</i>	
Das Konzept der Kapitalerhaltung als Instrument des Gläubigerschutzes	91
2 Mathematische Konzepte	111
<i>Ursula Walther</i>	
Zur Rolle der Finanzmathematik bei der Bewertung von Zahlungsströmen	113
<i>Stefan Huschens</i>	
Backtesting von Ausfallwahrscheinlichkeiten	137
<i>Klaus Berge, Stefan Fröhlich, Hermann Locarek-Junge</i>	
Erfahrungen bei der praktischen Anwendung der Extremwertanalyse	151
<i>Stefan Zeranski</i>	
Liquidity at Risk zur Steuerung des liquiditätsmäßig-finanziellen Bereichs von Kreditinstituten	171

3 Anwendungsfelder	207
<i>Walter Hagn, Ursula Walther</i>	
Risikomanagement im Firmenkundengeschäft	209
<i>Thomas Klaproth</i>	
Risikomanagement im Immobilienbereich – ein unterschätztes Thema aus Bankensicht?	229
<i>Steffen Metzner</i>	
Kennzahlengestützte Cash Flow-Analyse bei Immobilienanlagen und -finanzierungen	251
<i>Friedrich E. Hermann</i>	
Risikofrühwarnsystem in der Wohnungswirtschaft – Instrument zur Unternehmenssteuerung und Bonitätsbeurteilung bei Kreditinstituten	271
<i>Fabiana Rossaro</i>	
Risikogerechte Bepreisung von Bankgeschäften versus Verbraucherschutz – Festlegung von Zinslimits als Eingriff in die Risikopolitik von Kreditinstituten	297
<i>Eberhard Borgmann</i>	
Stromderivate – Anwendung im Risikomanagement und Bewertungsansätze	329
Autoren	347