Inhalt

Geleitwort V
Vorwort XIII
Herausgeber und Autoren XIX

Teil I: Aufsichtliche Anforderungen an Szenarioanalysen und Stresstests

Aufsichtliche Anforderungen an Stresstests für Kreditinstitute 3
Christine Fremdt/Manja Völz

Aufsichtliche Anforderungen an Stresstests für Versicherungen 23
Christoph Bennemann/Alexander Schalk

Teil II: Überblick über die Möglichkeiten und Grenzen von Szenarioanalysen und Stresstests

Entwicklung von Stresstests 41
Michael Krichbaum/Stefan Weiß

Systematisierung und Klassifizierung von Stresstests 61
Sven Ludwig/Jochen Pomper/Carsten S. Wehn

Quantitative Werkzeuge für die Durchführung von Stresstests 87
Stefan Reitz

Teil III: Umsetzung von Stresstests in einzelnen Risikoarten

Stresstests im Marktpreisrisiko 109
Valentin Gröger

Stresstests im Kreditrisiko 127
Walter Gruber/Ronny Hahn

Stresstests in Kontrahentenrisikomesssystemen 161
Marcus R. W. Martin

Stresstests im Rahmen des Liquiditätsrisikomanagements – aktueller Stand und Herausforderungen 177
Peter Bartetzky

Bibliografische Informationen
http://d-nb.info/1002407605

digitalisiert durch DEUTSCHE NATIONAL BIBLIOTHEK

Der Einsatz von Stresstests im Operationellen Risiko-Management 203
Maike Brunkert/Andreas Saemann

Stresstests für Projekte 227
Tobias Ihde

Teil IV: Steuerung mit Hilfe von Stresstests

Organisatorische Implikationen im Stresstestumfeld 247
Sven Fischer/Henning Heuter

Stresstests in der Gesamtbanksteuerung 275
Heinrich Paessens

Die Verankerung von Stresstesting in den Planungs- und Steuerungsprozessen einer Bank 319
Gerhard Schröck

Stresstests in der Versicherungspraxis 333
Roland Rusnak

Praxisbeispiel: Integration von Stresstests in die Steuerungssystematik der Wüstenrot 341
Jürgen Steffan/Marc Kaninke/Andreas Peter

Integrierte Stresstests auf Gesamtbankebene – Durchführung, Management Information und strategische Aspekte 355
Martin Knauber/Tobias Horn

Glossar 375

Stichwortverzeichnis 387