



Christian Schäffler
**Steuerung der Liquiditätsbevorratung in
Banken anhand eines quantitativen Trans-
ferpreismodells**

324 S., 61 s/w Abb., Broschiert

Preis: EUR 62,00

Erschienen im Juli 2011

ISBN: 978-3-8441-0055-6

Fachgebiet: Finanzierung, Kapitalmarkt und Ban-
ken

lieferbar

Kurzbeschreibung:

Im Mittelpunkt der vorliegenden Arbeit steht die Steuerung der Liquiditätsbevorratung anhand eines quantitativen Transferpreismodells in Banken. Diesbezüglich setzt sich die Arbeit mit den Fragestellungen eines optimalen Liquiditätsvorrats auseinander und analysiert die daraus entstehenden Opportunitäts- und Ausübungskosten anhand verschiedener Refinanzierungsstrategien (Fazilität, Repo, Veräußerung). Der kostenoptimale Einsatz dieser Strategien innerhalb eines Portfoliomodells bildet den Kern der Arbeit mit dem Ziel, die ermittelten Kosten anhand von Risikoprämien an die Liquiditätsverbraucher zu transformieren.

Zur Bestimmung der optimalen Liquiditätsbevorratung wird ein Ansatz gewählt, welcher zum einen quantitativ nachvollziehbar, zum anderen die Anforderungen der Bankenaufsicht berücksichtigt. Ziel ist diesbezüglich ein backtestbares Verfahren zur Bestimmung eines Teils des Vorrats – des Liquiditätspuffers – zu erstellen und zusätzlich ein mögliches Modellversagen über die Berücksichtigung von Stresstests (Liquiditätsreserve) zu kompensieren.

Anhand dieser Vorratsdefinition ist es möglich Kosten für die gängigsten Refinanzierungsmaßnahmen zu quantifizieren und in einem Modell, welches die Bildung von Klumpenrisiken mindestens abschwächt, zu modellieren. Die daraus resultierenden Risikoprämien werden anhand interner Geschäfte an die kostenverursachenden Abteilungen invertiert und abschließend noch ein institutsübergreifender Risikotransfer diskutiert.



Zielgruppe:

Das Buch richtet sich vornehmlich an Mitarbeiterinnen, Mitarbeiter und Führungskräfte in Kreditinstituten und Versicherungen, die mit der Risikosteuerung, der Risikomessung und den darin involvierten Methoden in den verschiedenen Risikoarten betraut sind. Ferner ist es als ein Leitfaden auch für Beraterinnen und Berater sowie als angewandte Lektüre für Studierende in den Bereichen Bankbetriebslehre, Betriebswirtschaft sowie Finanz- und Wirtschaftsmathematik zu verstehen.

Autor:

Dr. Christian Schäffler ist Partner von 1 PLUS i. Er absolvierte nach einer Banklehre ein betriebswirtschaftliches Studium an der Universität Augsburg. Im Rahmen seiner Dissertation am Center for Practical Quantitative Finance an der Frankfurt School of Finance and Management unter Prof. Dr. Thomas Heidorn setzte er sich detailliert mit dem Liquiditätsrisiko auseinander.

Das Handbuch ist erschienen im:

Josef Eul Verlag GmbH
Brandsberg 6, D-53797 Lohmar · Telefon: 02205 / 90106-6 · Telefax: 02205 / 90106-88
Internet: <http://www.eul-verlag.de> · E-Mail: info@eul-verlag.de · © 2011

