



Walter Gruber/Marcus R. W. Martin/Carsten S. Wehn (Hrsg.)

Szenarioanalysen und Stresstests in der Bank- und Versicherungspraxis

Regulatorische Anforderungen, Umsetzung, Steuerung

XXVII, 388 S., 121 s/w Abb., Gebunden

Preis: EUR 99,95

Erschienen am: 13.08.2010

ISBN: 3-7910-2953-3

ISBN: 978-3-7910-2953-5

Fachgebiet: Finanzierung / Investition

Produkttyp: Fachbuch

lieferbar

Kurzbeschreibung:

Stresstests und Szenarioanalysen erfreuen sich seit langem einer konstanten Aufmerksamkeit, welche jedoch insbesondere in den vergangenen zwei Jahren der Finanzkrise enorm hinzugewonnen hat. Der Grund hierfür liegt vor allem darin begründet, dass etablierte Risikomaße wie bspw. Value at Risk und Expected Shortfall gerade in Krisenzeiten an Aussagekraft verlieren, da die Beobachtungen per definitionem viel dramatischer sind als in normalen Zeiten. Dies können wahrscheinlichkeitbasierte Risikomaße, welche sich zur Gewinnung eines Risikomaßes der jeweiligen Vergangenheit bemühen und auf zahlreichen sehr restriktiven Modellannahmen beruhen, nur unzureichend reflektieren.

Diese Problematik hat auch zu einem gewissen Sinneswandel geführt: Inzwischen hinterfragt kein Bankpraktiker den Nutzen und die Sinnhaftigkeit von Stresstests, allein viele grundlegende Fragestellungen wie bspw. die Erstellung eines relevanten Szenarios, die Umsetzung im Risikomesssystem, die konkrete Steuerung mit Hilfe von Stresstests und eine stressorientierte Limitsystematik unterscheiden sich noch vielfach von Institut zu Institut.

Die Regulatoren tragen diesem enormen Bedeutungsgewinn gerade durch eine Novelle der MaRisk Rechnung, deren gestiegene Anforderungen umfassend thematisiert werden.

Das vorliegende Handbuch stellt den gesamten Themenkomplex bzgl. aller relevanten Risikoarten, den aufsichtlichen Anforderungen, den Auswirkungen und der Umsetzung auf die Banksteuerung in allen Facetten kompakt und aus Sicht des Anwenders dar, der vor der Aufgabe steht, sein Senior Management mit Hilfe von Stresstests oder Szenarioanalysen mit relevanten zu üblichen Risikomaßen komplementären Steuerungsinformationen zu versorgen. Hier wird einerseits Wert auf eine praxisorientierte Darstellung Wert gelegt ohne die vielfach notwendige theoretische Tiefe vermissen zu lassen. Hierfür garantieren insbesondere auch die Herausgeber und Autoren die großteils aus der Bank- und Beratungspraxis kommen und täglich mit den verschiedenen Problemstellungen konfrontiert sind.



Fax-Nr. Inland: 0800/ 77 77 77 0 (gebührenfrei)
Fax-Nr. Ausland: 0049 711 / 2194-119

Name, Vorname

Firma, Funktion

Straße, Hausnummer

PLZ, Ort

Telefon, E-Mail

Datum, Unterschrift

Schäffer-Poeschel Verlag
Vertrieb
Werastraße 21-23

70182 Stuttgart

Privatadresse

Firmenadresse

wfx

Bitte liefern Sie mir gegen Rechnung (zzgl. Versandkosten):

Pos	Anzahl	Titel	Einzelpreis	Summe
1		Gruber; Szenarioanalysen u. Stresstests ISBN: 978-3-7910-2953-5	99,95	