

**SCHÄFFER**  

---

**POESCHEL**

## Inhaltsverzeichnis

Vorwort zur 2. Auflage.....	V
Autorenverzeichnis.....	IX
<i>Jochen Flach / Heinrich Rommelfanger</i> Fuzzy-Logik-basiertes Bonitätsrating.....	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>Jörn Barth</i> Worst-Case Analysen des Ausfallrisikos eines Portfolios aus marktabhängigen Finanzderivaten.....	115
<i>Volker Läger / Andreas Oehler</i> Bewertung von Kreditderivaten mit Gegenparteirisiko.....	157
<i>Wolfgang Bühler / 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 Dürselen</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

## Autorenverzeichnis

*Dr. Jörn Barth*

Siemens AG, Siemens Management Consulting, München

*Prof. Dr. Dr. h.c. Wolfgang Bühler*

Lehrstuhl für ABWL und Finanzierung, Universität Mannheim

*Regierungsrat Dr. Thomas Dietz*

Gruppe D (Grundsatzfragen zu Marktrisikomodellen und deren Prüfung), Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht, Bonn

*Dipl.-Kfm. Dipl.-Hdl. Karl E. Dürselen*

Europäisches Studienzentrum Leverkusen der FernUniversität sowie Consultant und Trainer für Banken und Finanzdienstleister

*Dipl.-Wi.-Ing. Christoph Engel*

Wissenschaftlicher Mitarbeiter am Lehrstuhl für ABWL und Finanzierung, Universität Mannheim

*Dipl.-Kfm. Jochen Flach*

Deutsche Bundesbank, Frankfurt am Main

*Prof. Dr. Stefan Huschens*

Lehrstuhl für Quantitative Verfahren, insbesondere Statistik, Technische Universität Dresden

*Dr. Olaf Korn*

Wissenschaftlicher Assistent am Lehrstuhl für ABWL und Finanzierung, Universität Mannheim

*Dr. Volker Läger*

Merrill Lynch, Frankfurt am Main

*Prof. Dr. Hermann Locarek-Junge*

Lehrstuhl für Betriebswirtschaftslehre, insbes. Finanzwirtschaft und Finanzdienstleistungen, Technische Universität Dresden

*Dipl.-Wirtschaftsmath. Katja Pluto*

Deutsche Bundesbank, Abteilung Bankenaufsicht, Frankfurt

Vertreterin der Deutschen Bundesbank in der Models Task Force des Baseler Ausschusses für Bankenaufsicht

*Prof. Dr. Heinrich Rommelfanger*

Institut für Statistik und Mathematik, Universität Frankfurt

*Regierungsdirektor Gerhard Stahl*

Referatsleiter, Gruppe D (Grundsatzfragen zu Marktrisikomodellen und deren Prüfung), Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht, Bonn

*Abteilungspräsident Uwe Traber*

Leiter der Abteilung BA2 (Großbanken, Landesbanken und ausgewählte Kreditbanken) und der Gruppe D (Grundsatzfragen zu Marktrisikomodellen und deren Prüfung), Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht, Bonn

*Prof. Dr. Marliese Uhrig-Homburg*

Lehrstuhl für Financial Engineering und Derivate, Universität Karlsruhe (TH)

*Dipl.-Math. Konstantin Vogl*

Wissenschaftlicher Mitarbeiter am Lehrstuhl für Quantitative Verfahren, insbesondere Statistik, Technische Universität Dresden

*PD Dr. Helmut Zink*

Volkswirtschaftliches Institut, Universität Bern