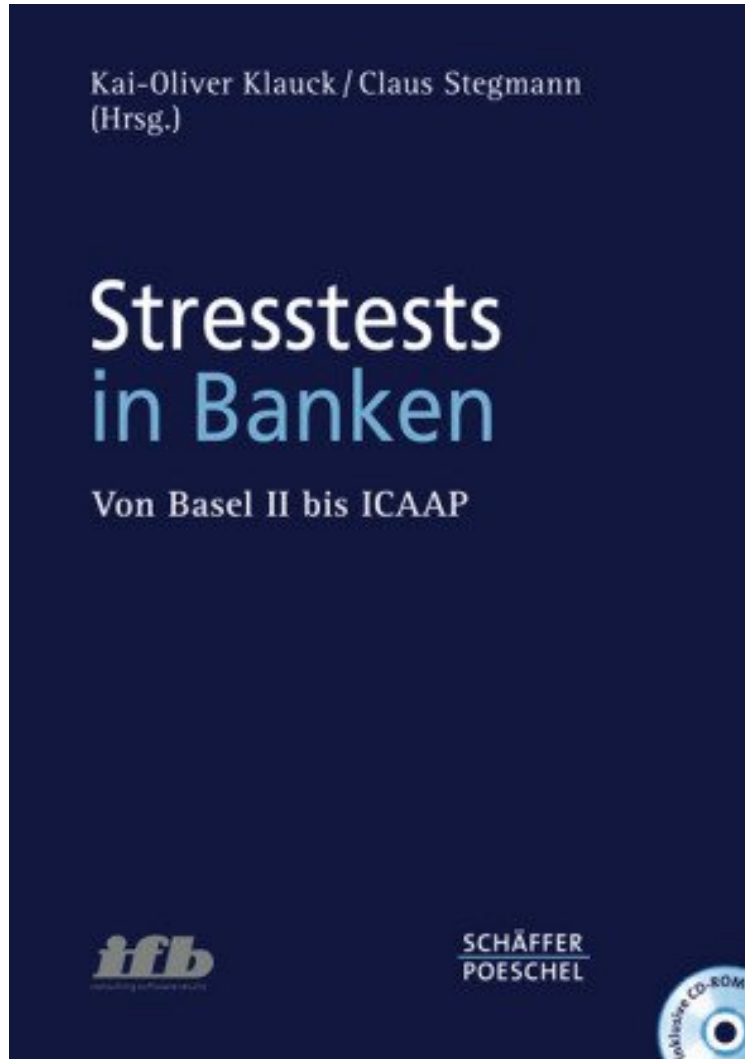


[Download ebook] Stresstests in Banken: Von Basel II bis ICAAP

Stresstests in Banken: Von Basel II bis ICAAP

Von Schffer-Poeschel

ePub | *DOC | audiobook | ebooks | Download PDF



DOWNLOAD



+

READ ONLINE

Produktinformation -Verkaufsrank: #1795244 in BcherVerffentlicht am: 2006-09Abmessungen: 9.72 x .75b x 5.83l, Einband: Gebundene Ausgabe197 Seiten | File size: 33.Mb

Von Schffer-Poeschel : Stresstests in Banken: Von Basel II bis ICAAP before purchasing it in order to gage whether or not it would be worth my time, and all praised Stresstests in Banken: Von Basel II bis ICAAP:

KundenrezensionenHilfreichste Kundenrezensionen3 von 3 Kunden fanden die folgende Rezension hilfreich. Gutes Buch fr Risikomanager im BankwesenVon Rolf DobelliDie etablierten Kennzahlen im Risikomanagement sind gut und schn, doch sie versagen in Zeiten, in denen ungewohnliche Ereignisse die Rahmenbedingungen an den Mrkten ndern. Stresstests helfen dem Risikomanager aus dieser Misere, indem sie ihm ein Instrument an die Hand geben, das den Einfluss extremer Ereignisse auf das Portfolio prft. Das Buch von Klauck und Stegmann geht Kapitel fr Kapitel auf unterschiedliche Aspekte von Stresstests ein und legt dabei sein Augenmerk auf die Rolle der Tests im Umfeld der neuen Eigenkapitalvorschriften Basel II. 14 Autoren stellen in ihren Beitrgen die diversen Stresstests vor und legen u.

a. dar, wie sie in der Kapitalallokation eingeführt werden können. Leser, die auf der Suche nach einer kleinschrittigen Stresstests-für-Dummies-Einführung sind, werden mit diesem Buch befördert sein: Der mit zahlreichen Formeln durchzogene Ratgeber setzt einiges an mathematischem Grundwissen voraus, und die oftmals akademische Ausdrucksweise tut ihr briges. Wir empfehlen das Buch daher in erster Linie erfahrenen Risikomanagern, die sich und ihre Bank mit Stresstests zusätzlich absichern möchten. Auch Berater, die Banken fit für Basel II machen, sind mit diesem Buch gut bedient.

Pressestimmen
Die Aspekte von Stresstests ein und legt dabei sein Augenmerk auf die Rolle der Tests im Umfeld der neuen Eigenkapitalvorschriften Basel II.2 (getAbstract) Kurzbeschreibung
Mit der Einführung von Stresstests betreten viele Banken Neuland beim Management von Kreditrisiken. Basel II und MaRisk machten Stresstests ab 2007 für jede Bank zur Pflicht. Für die praktische Umsetzung bietet dieses Buch erstmals eine umfassende Einführung und Vertiefung, die den Leser Schritt für Schritt mit der Anwendung von Stresstests vertraut macht: Von der Definition der Szenarien über die empirische Überprüfung der Methoden bis zur Integration in den Prozess der Kapitalallokation. Die beiliegende CD-ROM mit dem ifb-Portfoliogenerator gibt dem Leser zudem die Möglichkeit, Stresstests zu simulieren und versuchsweise anzuwenden.
Der Autor und weitere Mitwirkende
Dr. Kai-Oliver Klauck, Managing Consultant, ifb AG; Claus Stegmann, Mitglied des Vorstands, ifb AG, Leiter des Geschäftsbereichs SAP Services