

SCHÄFFER
POESCHEL

Inhalt

Geleitwort	V
Vorwort	XIII
Herausgeber und Autoren	XIX

Teil I: Aufsichtliche Anforderungen an Szenarioanalysen und Stresstests

Aufsichtliche Anforderungen an Stresstests für Kreditinstitute	3
<i>Christine Fremdt/Manja Völz</i>	
Aufsichtliche Anforderungen an Stresstests für Versicherungen	23
<i>Christoph Bennemann/Alexander Schalk</i>	

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

Entwicklung von Stresstests	41
<i>Michael Krichbaum/Stefan Weiß</i>	
Systematisierung und Klassifizierung von Stresstests	61
<i>Sven Ludwig/Jochen Pomper/Carsten S. Wehn</i>	
Quantitative Werkzeuge für die Durchführung von Stresstests	87
<i>Stefan Reitz</i>	

Teil III: Umsetzung von Stresstests in einzelnen Risikoarten

Stresstests im Marktpreisrisiko	109
<i>Valentin Gröger</i>	
Stresstests im Kreditrisiko	127
<i>Walter Gruber/Ronny Hahn</i>	
Stresstests in Kontrahentenrisikomesssystemen	161
<i>Marcus R. W. Martin</i>	
Stresstests im Rahmen des Liquiditätsrisikomanagements – aktueller Stand und Herausforderungen	177
<i>Peter Bartetzky</i>	

Der Einsatz von Stresstests im Operationellen Risiko-Management 203
Maïke 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