

SCHÄFFER
POESCHEL

Inhalt

Geleitwort	V
Vorwort der Herausgeber.....	VII
Die Herausgeber	XI
Die Autoren.....	XII

Abgrenzung und Begriffsdefinition Treasury

Rahmenbedingungen des Treasury im Kontext der Gesamtbanksteuerung	3
<i>Hendryk Braun/Henning Heuter</i>	
Klassischer Treasury-Ansatz im Kontext des Asset-Liability-Managements.....	17
<i>Korbinian Hammer</i>	

Zins- und FX-Steuerung

Periodenorientierte Steuerung der Zinsänderungsrisiken in kleinen und mittleren Kreditinstituten.....	43
<i>Sven Schwerdtner/Daniel Markus</i>	
Zinsrisikomanagement: Fristentransformation, Bewertung variabler Produkte und Treasury-Aktivitäten.....	75
<i>Silvio Andrae</i>	
Ganzheitliche Steuerung des Fremdwährungsrisikos	103
<i>Hendryk Braun</i>	
Treasury-Steuerung mit strukturierten Zinsprodukten.....	119
<i>Christian Karl/Markus Haspel</i>	

Kreditrisiken

Methoden der Kreditrisikoquantifizierung und deren Implikation auf die Steuerungsprozesse	139
<i>Robert G. Kaltfofen/Ronny Hahn</i>	
Produkte der Kreditrisikosteuerung: CDS und Index-Produkte	169
<i>Peter N. Posch</i>	

Effiziente Risikosteuerung durch strukturierte Risikotransfer-Instrumente (RTI). 187
Heike Sonnert

Bewertung von Krediten mit Tilgungsrechten 233
Bernd Engelmann

Liquiditätsrisiken

Collateral Management 259
Jürgen Pohl

Steuerung der taktischen und strukturellen Liquidität unter Einfluss
anderer Risikoarten..... 281
Sebastian Bodemer

Liquiditätsstresstests und Notfallplanung 309
Thomas Heidorn/Christian Schäffler

Integrative Steuerung

Kapital als Portfolio..... 347
Frank Eggers/Sylvia Baudisch

Performancerechnung, Performanceauskehr und Überleitungsrechnung..... 377
Ralf Stechhammer/Sonja Michas

Effiziente Asset-Allocation in Kreditinstituten – 413
Ursula Theiler/Dominik Dersch

Benchmarkorientierte Steuerung von Kredit- und Zinsportfolien 453
Ronny Graupeter

Risikoaggregation und integratives Reporting in der Gesamtbank..... 469
Henning Heuter/Stefan Reitz

Stichwortverzeichnis..... 501