

978-3-7910-3319-8 Burghof/Rudolph/Schäfer/Schönbucher/Sommer (Hrsg.), Kreditderivate/
3., überarbeitete Auflage
© 2015 Schäffer-Poeschel Verlag (www.schaeffer-poeschel.de)

SCHÄFFER
POESCHEL

Inhaltsverzeichnis

Vorwort zur dritten Auflage	V
Vorwort zur zweiten Auflage	VII
Vorwort zur ersten Auflage	IX
Autorenverzeichnis	XV
I Einführung	1
<i>Klaus Schäfer</i>	
I.1 Aufbau des Buchs	3
<i>Hans-Peter Burghof/Stephan Paul/Bernd Rudolph</i>	
I.2 Funktionen und Entwicklung der Märkte für den Kreditrisikotransfer	9
II Produkte zum Transfer von Kreditrisiken	47
<i>Dietmar Franzen/Klaus Schäfer</i>	
II.1 Grundstrukturen bei Kreditderivaten	49
<i>Dietmar Franzen</i>	
II.2 Kreditindizes und Kreditindexoptionen	67
<i>Markus Herrmann</i>	
II.3 Kreditverbriefungen, CLOs und Kreditderivate	81
<i>Andreas Horsch/Sylvia Fiedler</i>	
II.4 Alternative Formen des Kreditrisikotransfers	107
III Entwicklungen am Markt für Kreditderivate	145
<i>Claus Dülfer</i>	
III.1 Marktstruktur, Marktfraktionen und Einflussfaktoren neuer Regularien	147
<i>Manuela Haug/Kirsten Schenk</i>	
III.2 Derivateregulierung – Handelsplätze, Clearing und Reporting	181

IV	Einsatzfelder für Kreditderivate und Einsatz- sowie Handelsbedingungen	207
	<i>Günter Franke</i>	
IV.1	Risikomanagement mit Kreditderivaten	209
	<i>Florian Kramer/Tobias Linder/Christian Wenninger</i>	
IV.2	Einsatzfelder von Kreditderivaten bei Versicherungen und Pensionsfonds.	231
	<i>Ralf Lierow</i>	
IV.3	Einsatz von Kreditderivaten im Risikomanagement von Industrieunternehmen	247
	<i>Christoph Klein</i>	
IV.4	Einsatz von Kreditderivaten im aktiven Portfoliomanagement	269
	<i>Thomas Hartmann-Wendels</i>	
IV.5	Bedingungen für die Handelbarkeit von Buchkrediten	279
	<i>Jürgen Häcker/Christoph Lieder/Maximilian Schmidt</i>	
IV.6	Anforderungen an die Datenverarbeitung von Kreditderivaten	301
V	Rechtliche und regulatorische Rahmenbedingungen	331
	<i>Marc Benzler/Ute Brunner-Reumann</i>	
V.1	Zivilrechtliche Einordnung von Kreditderivaten	333
	<i>Marc Benzler/Ute Brunner-Reumann</i>	
V.2	Vertragsdokumentation und Standardisierung	359
	<i>Dirk Auerbach/Daniela Klotzbach</i>	
V.3	Bilanzierung von Kreditderivaten nach HGB	389
	<i>Dirk Auerbach/Daniela Klotzbach</i>	
V.4	Bilanzierung von Kreditderivaten nach IFRS	413
	<i>Hans-Jürgen A. Feyerabend/Brigitta Kieninger</i>	
V.5	Steuerliche Behandlung von Kreditderivaten	435
	<i>Markus Lange/Hagen Tiller</i>	
V.6	Insolvenzrechtliche Behandlung von Kreditderivaten	479
	<i>Hermann Schulte-Mattler/Dorothea Meyer-Ramloch</i>	
V.7	Bankaufsichtliche Behandlung von Kreditderivaten	501

	<i>Nadine von Saldern</i>	
V.8	Kreditderivate: Aufsichtliche Behandlung bei Versicherungen	535
VI	Bewertung von Kreditderivaten	553
	<i>Lutz Schlögl</i>	
VI.1	Bewertungsmodelle für Ausfallrisiken: Eine Literaturübersicht	555
	<i>Philipp J. Schönbucher/Daniel Sommer</i>	
VI.2	Die Implementierung von Intensitätsmodellen	573
	<i>Philipp J. Schönbucher</i>	
VI.3	Kreditrisikomodelle zur Bewertung von Kreditderivaten	593
	<i>Vahe Andonians/David Blum/Martin Hellmich</i>	
VI.4	Bewertung und Hedging von Korrelationsprodukten im Kreditderivatemarkt	639
	Glossar Kreditderivate	665
	Stichwortverzeichnis	679