

Buchinformation



Klement, Jochen

Kreditrisikohandel, Basel II und interne Märkte in Banken

2007. XXX, 414 S., 81 Abb., 47 Tab., Br. € 59,90
ISBN 978-3-8350-0672-0

Deutscher Universitäts-Verlag ist ein
Gemeinschaftsunternehmen von
Gabler, Vieweg, VS Verlag

DUV | GWV Fachverlage GmbH
Abraham-Lincoln-Straße 46
65189 Wiesbaden | Germany

www.duv.de

Die aus Basel II resultierenden Anforderungen bzw. die neue Solvabilitätsverordnung erfordern interne Steuerungsmechanismen und neue Möglichkeiten des Kreditrisikotransfers. Hier bietet sich das Konstrukt des internen Marktes an, das die Flexibilität der Institute aufgrund kurzer Entscheidungswege erheblich verbessert. Die dezentrale Banksteuerung verfügt damit über ein neues Element, das im Rahmen des integrierten Bankcontrollings implementiert werden kann.

Jochen Klement analysiert auf der Basis der ökonomischen und aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen das Einsatzpotenzial interner Märkte, um so die Allokation des haftenden Eigenkapitals im Kreditbereich optimal zu gestalten. Er erarbeitet Kriterien für ein Handelssystem für Kreditrisiken und entwickelt darauf aufbauend ein Vorgehen zur Implementierung eines Systems, das einerseits Reportingzwecken dient und andererseits einen (semi-)internen Markt abbildet. Mit Hilfe dieses Systems werden Experimente durchgeführt, die vor allem die Vorteilhaftigkeit semiinterner Märkte bestätigen.

Dr. Jochen Klement promovierte bei Prof. Dr. Manfred Steiner am Lehrstuhl für Finanz- und Bankwirtschaft der Universität Augsburg. Er ist Consultant der 1 PLUS i GmbH, Nürnberg.



Bitte liefern Sie mir zum Ladenpreis

Fax: 0611/7878-420

<input type="checkbox"/> Autor: Klement Titel: Kreditrisikohandel, Basel II und interne Märkte in Banken ISBN: 978-3-8350-0672-0

Änderungen vorbehalten. Stand 02/07

Vorname Name

Uni / Firma

Institut / Abteilung

Straße (bitte kein Postfach!)

PLZ / Ort

Datum _____ Unterschrift _____