

# Marktzinsorientierte Ergebnisspaltung des Eigenhandels von Kreditinstituten

## F. Knapp - Management von Refinanzierungsrisiken in Kreditinstituten

Description: -

-

Church and state -- Catholic Church -- History.

Papacy -- History.

Urbanization -- Environmental aspects -- Washington (State) --

Pierce County.

Runoff -- Washington (State) -- Pierce County -- Computer simulation.

Hydrology -- Washington (State) -- Pierce County.

Bank loans -- Germany.

Bank management -- Germany. Marktzinsorientierte Ergebnisspaltung des Eigenhandels von Kreditinstituten

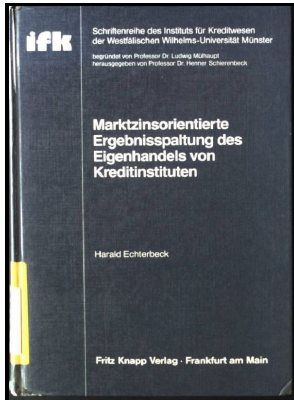
-

Bd. 42

Schriftenreihe des Instituts für Kreditwesen der Westfälischen Wilhelms-Universität Münster ; Marktzinsorientierte Ergebnisspaltung des Eigenhandels von Kreditinstituten

Notes: Includes bibliographical references (p. 256-266).

This edition was published in 1991



Filesize: 10.73 MB

Tags: #in #Kreditinstituten #Dissertation #zur #Erlangung #des #akademischen #Grades #eines #Doktors #der #Wirtschaftswissenschaften #(Dr. #rer. #pol.)

### Eigenhandel

Die Berücksichtigung von Credit Spreads im Rahmen der Kalkulation und Steuerung von Zinsrisikogeschäften führt somit zu einer verbesserten Abbildung der Marktrealität und einem differenzierten Ausweis der Ergebnisquellen. Sofern lediglich die formulierte Anforderung fixierter Cashflows nicht erfüllt wird, folgt auch daraus eine Bewertung zum Zeitwert. Zu nennen ist an dieser Stelle zunächst das Varianz-Kovarianz-Modell, das durch die Ermittlung von Varianzen und Kovarianzen der Risikoparameter eine Aussage über die potenzielle Wertänderung trifft.

**Marktzinsorientierte Ergebnisspaltung des Eigenhandels von Kreditinstituten (F. Knapp): 1991 | 書誌詳細 | 国立国会図書館サーチ**

Eine Normstrategie muss die Ertragserwartungen und die Risikoneigung eines Kreditinstituts treffen. Dem Risikomanagement obliegen Limitfestlegung und -kontrolle sowie die Entwicklung und Überwachung bankinterner Strategien für den Eigenhandel.

**Marktzinsorientierte Ergebnisplanung des Eigenhandels von Kreditinstituten.: vip.stumagz.com: Echterbeck, Harald.: Bücher**

Für das Anlagebuch besteht ein Wahlrecht, die Geschäfte zu den fortgeführten Anschaffungskosten anzusetzen. Der Umsetzungszeitraum der neuen Anforderungen erstreckt sich von 2012 bis 2014. Zusätzlich zu den verschärften Eigenkapitalanforderungen steigen durch Basel III die Liquiditätsanforderungen, da spätestens ab 2014 durch Liquiditätskennziffer über die Liquiditätssituation laufend berichtet werden muss. Allerdings kann das Institut nicht sicher davon ausgehen, dass die Rendite bis zur Fälligkeit des Wertpapiers erwirtschaftet werden kann, da die Refinanzierung nicht laufzeitkongruent abgeschlossen wurde.

### Eigenhandel • Definition

Eine detaillierte Chronik der Subprime- und Finanzmarktkrise findet sich im Finanzstabilitätsbericht Vgl. Daraus folgt, dass ausschließlich risikoeffiziente Steuerungsentscheidungen, die zu einer Stabilisierung bzw. Das Bruttoinlandsprodukt sinkt um 6,9 % und 8,8 %.

## **BaFin**

Sie bündeln die originären Hypothekenkredite in Mortgage-backed Securities MBS und Collateralized Debt Obligations CDO , und verkaufen diese nun handelbaren Forderungen über den Kapitalmarkt weiter.

### **Marktinsorientierte Ergebnisplanung des Eigenhandels von Kreditinstituten.: vip.stumagz.com: Echterbeck, Harald.: Bücher**

Positive Marktinformationen können in gleicher Weise zu einem Ansteckungseffekt und einer marktweiten Verengungen der Credit Spreads führen. Darüber hinaus zeigt die Abbildung, dass auch der Laufzeitspread aus der Zinsstrukturkurve im Beobachtungszeitraum deutlichen Schwankungen unterliegt. Während Benchmarkszenarien meist auf konstruierte Zinsszenarien, wie bspw.

## **BaFin**

Die Studien zu den Einflussfaktoren auf Credit Spreads identifizieren weiter den Leverage-Faktor als relevante Determinante. Sie können aber auch durch Risikofaktoren verstärkt werden, die durch gleichgerichtete Risikofaktoren unterschiedlicher Risikoarten entstehen Inter-Risikokonzentrationen.

## **â**

Das Mutterinstitut gibt lediglich Kreditzusagen. Eine detaillierte Chronik der Subprime- und Finanzmarktkrise findet sich im Finanzstabilitätsbericht Vgl. Tabelle 61 325 Tabelle 77: Basis Spreads AAA - A: -220 BP adhoc vgl.

## Related Books

- [Frauen, Körper, Kunst - Dokumentation der Tagungen Frauen, Körper, Kunst, 1991-1994 : Hochschule f](#)
- [Neither fear nor favour](#)
- [Lao She yan jiu zi liao](#)
- [7 octobre](#)
- [Mentoring foreign language teaching assistants, lecturers, and adjunct faculty](#)