



## Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk"

By Benedikt Niemann

GRIN Publishing Sep 2014, 2014. Taschenbuch. Condition: Neu. Neuware - Akademische Arbeit aus dem Jahr 2006 im Fachbereich BWL - Controlling, Note: 1,0, , Sprache: Deutsch, Abstract: Diese Arbeit befasst sich mit dem Value at Risk Neben einer detaillierten Darstellung des Konzeptes liegt ein besonderes Augenmerk dieser Arbeit auf der Analyse der in der Praxis häufig angewandten Berechnungsverfahren (Varianz-Kovarianz-Ansatz, historische Simulation und Monte Carlo Simulation) sowie auf der Erläuterung wichtiger methodischer Grundlagen. Seit Beginn der 1970er Jahre rückten sowohl für Institutionen des Finanz- als auch des Nichtfinanzsektors Marktpreisrisiken verstärkt in den Mittelpunkt. Um diesen Risiken entgegenzuwirken, wurden Derivate eingesetzt - zunächst vor allem in Form von Futures und Forwards. Der ungeeignete und falsch verstandene Einsatz von Derivaten führte dabei in den frühen 1990er Jahren zu enormen finanziellen Einbußen bei Firmen wie Orange County, Barings und Metallgesellschaft. Jedoch nicht nur durch die Verbreitung von derivativen Instrumenten, sondern auch wegen der zunehmenden Bedeutung der Unternehmensperformance und Marktliquidität, kommt einer aggregierten Messung von Marktpreisrisiken ein immer größerer Wert zu. Infolge von gesetzlichen Anordnungen seitens der Kreditinstitute wurden fortwährend neue Messverfahren entwickelt. Eines dieser Verfahren, das sich mittlerweile im Finanzsektor und vor allem im Bankenbereich erfolgreich bewährt und durchgesetzt hat, ist das Risikomaß VaR. Diverse...



**READ ONLINE**  
[ 6.94 MB ]

### Reviews

*This book might be worth a study, and superior to other. It can be written in easy words and phrases and never confusing. I am just happy to inform you that here is the greatest ebook i have got read within my personal daily life and may be the best pdf for actually.*

-- Mrs. Avis Little DDS

*This pdf can be worth a read through, and a lot better than other. I really could comprehend everything using this written e book. I am just pleased to explain how this is actually the very best book i have read through in my individual lifestyle and can be the very best publication for actually.*

-- Jaclyn Price

## Related Books



### Milan CityMap hallwag r/v (r) wp: Zentrum. U-Bahn. Transit. Index (City Map)

Hallwag, 2012. Map. Book Condition: New. Brand new books and maps available immediately from a reputable and well rated UK bookseller - not sent from the USA; despatched promptly and reliably worldwide by Royal Mail;



### Studyguide for Constructive Guidance and Discipline: Preschool and Primary Education by Marjorie V. Fields ISBN: 9780136035930

2009. Softcover. Book Condition: New. 5th. 8.25 x 11 in. Never HIGHLIGHT a Book Again! Includes all testable terms, concepts, persons, places, and events. Cram101 Just the FACTS101 studyguides gives all of the outlines, highlights, and quizzes for your textbook with optional...



### The Whale Tells His Side of the Story Hey God, Ive Got Some Guy Named Jonah in My Stomach and I Think Im Gonna Throw Up

B&H Kids. Hardcover. Book Condition: New. Cory Jones (illustrator). Hardcover. 32 pages. Dimensions: 9.1in. x 7.2in. x 0.3in.Oh sure, well all heard the story of Jonah and the Whale a hundred times. But have we heard it from the perspective of the...



### Stories from East High: Bonjour, Wildcats v. 12

Parragon Book Service Ltd, 2009. Paperback. Book Condition: New. A new, unread, unused book in perfect condition with no missing or damaged pages. Shipped from UK. Orders will be dispatched within 48 hours of receiving your order. Orders are dispatched Monday â"...



### Sulk: Kind of Strength Comes from Madness v. 3

Top Shelf Productions, United States, 2010. Paperback. Book Condition: New. 160 x 114 mm. Language: English . Brand New Book. Jeffrey Brown explores the world of fantasy and science fiction, and turns it on its head. Or rather, just kind of tilts...



### Portrait of a Marriage: V. Sackville-West and Harold Nicolson

Atheneum. PAPERBACK. Book Condition: New. 0689705972 12+ Year Old paperback book-Never Read-may have light shelf or handling wear-has a price sticker or price written inside front or back cover-publishers mark-Good Copy- I ship FAST with FREE tracking!!!! \* I am a reputable...