



Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition)

Benedikt Niemann

Download now

[Click here](#) if your download doesn't start automatically

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition)

Benedikt Niemann

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) Benedikt Niemann

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 Aufsichtsbehörden, u. a. das Baseler Komitee und die Securities and Exchange Commission (SEC), haben sich darauf verständigt, dass Finanzinstitute zur Eigenkapitalhinterlegung den VaR zur Risikomessung verwenden müssen. Ziel der Arbeit ist daher die Beantwortung der eingangs gestellten Frage, ob der VaR auch zur Risikomessung in Unternehmen verwendet werden kann.

Aus dem Inhalt:

- Value at Risk als Risikomaß,
- Berechnungsmethoden,
- kritische Analyse,
- Value at Risk im Nichtfinanzsektor

 [Download Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Ris ...pdf](#)

 [Read Online Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at R ...pdf](#)

Download and Read Free Online Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) Benedikt Niemann

From reader reviews:

David Russell:

The book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) can give more knowledge and information about everything you want. So why must we leave the great thing like a book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition)? A number of you have a different opinion about reserve. But one aim this book can give many data for us. It is absolutely correct. Right now, try to closer with the book. Knowledge or facts that you take for that, you can give for each other; you can share all of these. Book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) has simple shape however you know: it has great and massive function for you. You can seem the enormous world by available and read a e-book. So it is very wonderful.

Della Francis:

This book untitled Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) to be one of several books that best seller in this year, that's because when you read this e-book you can get a lot of benefit into it. You will easily to buy that book in the book retail store or you can order it by way of online. The publisher of this book sells the e-book too. It makes you more easily to read this book, as you can read this book in your Smart phone. So there is no reason to your account to past this publication from your list.

Alexander Goodman:

This Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) is great reserve for you because the content and that is full of information for you who else always deal with world and have to make decision every minute. That book reveal it data accurately using great plan word or we can point out no rambling sentences within it. So if you are read the item hurriedly you can have whole data in it. Doesn't mean it only provides you with straight forward sentences but challenging core information with lovely delivering sentences. Having Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) in your hand like having the world in your arm, data in it is not ridiculous 1. We can say that no publication that offer you world in ten or fifteen tiny right but this e-book already do that. So , this is certainly good reading book. Hey Mr. and Mrs. hectic do you still doubt that?

Janice Hayes:

A number of people said that they feel bored stiff when they reading a reserve. They are directly felt that when they get a half elements of the book. You can choose the book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) to make your own reading is interesting. Your own personal skill of reading proficiency is developing when you including reading. Try to choose simple book to make you enjoy to read it and mingle the sensation about book and examining especially. It is to be initially opinion for you to like to wide open a book and go through it. Beside that the e-book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) can to be your friend when you're feel alone and confuse using what must

you're doing of the time.

**Download and Read Online Konzept und Berechnungsverfahren
des "Value at Risk" (German Edition) Benedikt Niemann
#S2JCKA9Y1U0**

Read Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann for online ebook

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann Free PDF d0wnl0ad, audio books, books to read, good books to read, cheap books, good books, online books, books online, book reviews epub, read books online, books to read online, online library, greatbooks to read, PDF best books to read, top books to read Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann books to read online.

Online Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann ebook PDF download

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann Doc

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann Mobipocket

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by Benedikt Niemann EPub