Google Drive

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 Anthony:

The book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) gives you the sense of being enjoy for your spare time. You can use to make your capable much more increase. Book can to become your best friend when you getting strain or having big problem along with your subject. If you can make reading through a book Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) being your habit, you can get far more advantages, like add your own personal capable, increase your knowledge about a number of or all subjects. You can know everything if you like available and read a reserve Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition). Kinds of book are several. It means that, science guide or encyclopedia or other folks. So , how do you think about this e-book?

Patricia Little:

This book untitled Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) to be one of several books which best seller in this year, this is because when you read this e-book you can get a lot of benefit on it. You will easily to buy that book in the book shop or you can order it by using online. The publisher on this book sells the e-book too. It makes you easier to read this book, as you can read this book in your Smartphone. So there is no reason for your requirements to past this book from your list.

Anne Corchado:

Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) can be one of your beginning books that are good idea. All of us recommend that straight away because this e-book has good vocabulary that will increase your knowledge in vocab, easy to understand, bit entertaining however delivering the information. The article writer giving his/her effort to place every word into enjoyment arrangement in writing Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) however doesn't forget the main place, giving the reader the hottest along with based confirm resource facts that maybe you can be one among it. This great information can drawn you into brand new stage of crucial pondering.

Phyllis Thompson:

You can obtain this Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) by check out the bookstore or Mall. Just viewing or reviewing it may to be your solve difficulty if you get difficulties for ones knowledge. Kinds of this guide are various. Not only simply by written or printed but in addition can you enjoy this book by means of e-book. In the modern era such as now, you just looking of your mobile phone and searching what their problem. Right now, choose your own ways to get more information about your e-book. It is most important to arrange you to ultimately make your knowledge are still upgrade. Let's try to choose suitable ways for you.

Download and Read Online Konzept und Berechnungsverfahren des "Value at Risk" (German Edition) Benedikt Niemann #UANM1F278RL

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