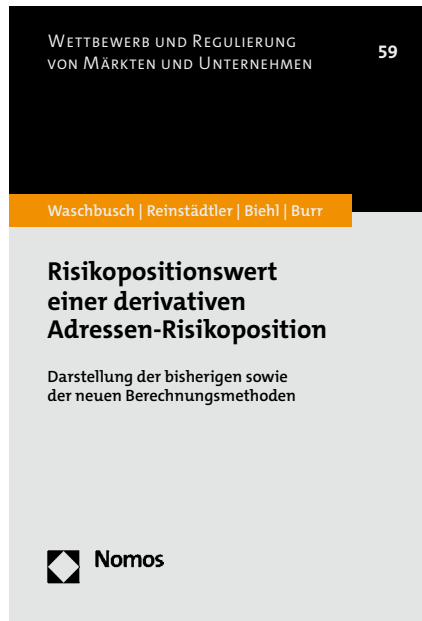




Nomos

Risikopositionswert einer derivativen Adressen-Risikoposition



Risikopositionswert einer derivativen Adressen-Risikoposition

Darstellung der bisherigen sowie der neuen Berechnungsmethoden

Von Univ.-Prof. Dr. Gerd Waschbusch, Dr. Gabriela Reinstädler, Jonathan Biehl, M.Sc. und Julius Burr, M.Sc.

2023, 262 S., brosch., 64,- €

ISBN 978-3-7560-0634-2

(Wettbewerb und Regulierung von Märkten und Unternehmen, Bd. 59)

www.nomos-shop.de/isbn/978-3-7560-0634-2

Das Buch behandelt eingehend die Methoden zur Berechnung des Risikopositionswerts einer derivativen Adressen-Risikoposition bei Instituten. Hierzu erfolgt zuerst eine Betrachtung des Terminus Risiko mit einem besonderen Fokus auf Adressenrisiken. Hieran anknüpfend werden die Grundlagen der Quantifizierung des Adressenrisikos beleuchtet, wobei das Hauptaugenmerk auf der Behandlung einer derivativen Adressen-Risikoposition liegt. Darauf auf-

bauend werden die bisherigen und die neuen Methoden zur Berechnung des Risikopositionswerts einer derivativen Adressen-Risikoposition detailliert dargestellt. Abschließend wird die Bedeutung des Risikopositionswerts einer derivativen Adressen-Risikoposition für die Bestimmung des Gesamtrisikobetrags sowie der aufsichtsrechtlichen Mindestkapitalquoten herausgearbeitet.

Bestell-Hotline +49 7221 2104-260 | Online www.nomos-shop.de
E-Mail bestellung@nomos.de | Fax +49 7221 2104-265 | oder im Buchhandel

Sie haben das Recht, die Ware innerhalb von 14 Tagen nach Lieferung ohne Begründung an Nördlinger Verlagsauslieferung GmbH & Co. KG, Augsburg Str. 67A, 86720 Nördlingen zurückzusenden. Bitte nutzen Sie bei Rücksendungen im Inland den kostenlosen Abholservice. Ein Anruf unter Tel. +49 7221 2104-260 genügt. Unsere Datenschutzbestimmungen finden Sie unter nomos@shop.de/go/datenschutzerklaerung.

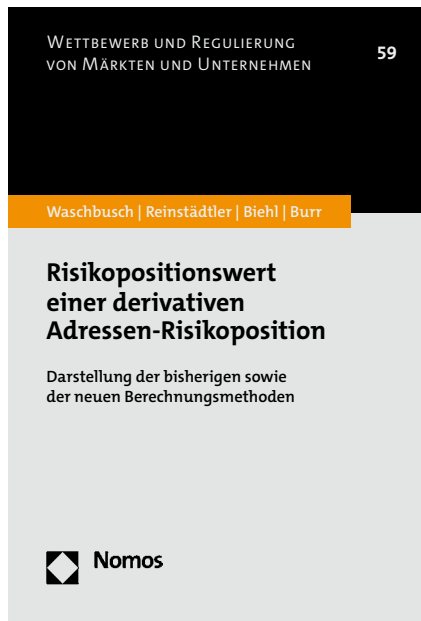
Nomos Verlagsgesellschaft
Waldseestraße 3–5 | D-76530 Baden-Baden | www.nomos.de

 Nomos
eLibrary



Nomos

Exposure Value of a Derivative Counterparty Risk Position



Risikopositionswert einer derivativen Adressen-Risikoposition

Darstellung der bisherigen sowie
der neuen Berechnungsmethoden

By Univ.-Prof. Dr. Gerd Waschbusch,
Dr. Gabriela Reinstädler, Jonathan Biehl, M.Sc.
and Julius Burr, M.Sc.

2023, 262 pp., pb., € 64.00

ISBN 978-3-7560-0634-2

(Wettbewerb und Regulierung von Märkten und
Unternehmen, vol. 59)

in German

www.nomos-shop.de/isbn/978-3-7560-0634-2

This book deals in detail with the methods used to calculate the risk position value of a derivative counterparty risk position at institutions. To this end, it first examines the term risk, focusing especially on counterparty risks. Subsequently, it addresses the basics of quantifying counterparty risk, focusing principally on the treatment of a derivative counterparty risk position. Based on this, the

previous and new methods of calculating the risk position value of a derivative counterparty risk position are presented in detail. Finally, the authors assess the significance of the risk position value of a derivative counterparty risk position in determining the overall amount of risk and the regulatory minimum capital ratios.

Hotline for your order +49 7221 2104-260 | Online www.nomos-shop.de
E-Mail orders@nomos.de | Fax +49 7221 2104-265 | or in your local bookstore

You can withdraw from your book order without giving reasons within fourteen days. Simply send your written withdrawal within the given period to: Nördlinger Verlagsauslieferung GmbH & Co. KG, Augsburgstr. 67A, 86720 Nördlingen, Germany or to your bookstore. A withdrawal binds you to return the items. All costs and risks of return are payable by the addressee. You can find our privacy policy online at nomos@shop.de/go/datenschutzerklaerung.

Nomos Verlagsgesellschaft
Waldseestraße 3–5 | D-76530 Baden-Baden | www.nomos.de

 Nomos
eLibrary