

## Literaturverzeichnis

- Abel, Volker, Wolff, Roland* (Bedeutung Risikotragfähigkeit, 2016): Umsetzungs Herausforderungen in der Praxis – Integriertes Engpassmanagement zur Sicherstellung von Kapitaladäquanz und -effizienz, in: Reuse, Svend (Hrsg.): *Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit*, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 207 – 225.
- Ahrens, Ralf* (Marktbasierte Zinsprognosen, 2000): Marktbasierte Zinsprognosen mit Regime-Switching-Modellen, (zugl. Diss. Justus-Liebig-Universität Gießen 2000) in: *Ashauer, Günter, Breuer, Wolfgang, Krümmel, Hans-Jürgen, Rudolph, Bernd, Weber, Axel* (Hrsg.): *Untersuchung über das Spar-, Giro- und Kreditwesen*, Band 169, Berlin: Duncker & Humblot Verlag 2000.
- Albrecht, Peter, Maurer, Raimond* (Investmentmanagement, 2008): *Investment- und Risikomanagement*, 3. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2008.
- Artzner, Philippe, Delbean, Freddy, Eber, Jean-Marc, Heath, David* (Kohärente Risikomaße, 1999): Coherent Measures of Risk, in: *Mathematical Finance*, 9 (1999), Nr. 3, S. 203 – 228.
- Auer, Benjamin, Rottmann, Horst* (Ökonometrie, 2010): *Statistik und Ökonometrie für Wirtschaftswissenschaftler – Eine anwendungsorientierte Einführung*, Wiesbaden: Gabler Verlag 2010.
- Auer, Benjamin, Holland, Heinrich, Kamps, Udo, Lübbecke, Marco, Rottmann, Horst* (Wirtschaftsmathematik, 2013): *Kompakt-Lexikon Wirtschaftsmathematik und Statistik*, in: *Springer Fachmedien Wiesbaden* (Hrsg.): *Kompakt-Lexikon Wirtschaftsmathematik und Statistik*, Wiesbaden: Springer Gabler Verlag 2010.
- Bali, Turan, Heidari, Massed, Wu, Liuren* (Informationseffizienz Zinsmarkt, 2006): Predictability of Interest Rates and Interest-Rate Portfolios, <http://www.bankofcanada.ca/wp-content/uploads/2010/09/bali.pdf>, (Zugriff 2017-03-10, 16:44 MEZ).
- Bank of Japan* (Leitzins, 2017): BOJ's Main Time-series Statistics, IR01/MADR1Z@D, [http://www.stat-search.boj.or.jp/ssi/mtshtml/ir01\\_d\\_1\\_en.html](http://www.stat-search.boj.or.jp/ssi/mtshtml/ir01_d_1_en.html), (Zugriff 2017-04-08, 15:00 MEZ).
- Bartetzky, Peter* (Risikotragfähigkeit, 2012): Ermittlung des Risikodeckungsponzials, in: *Bartetzky, Peter* (Hrsg.): *Praxis der Gesamtbanksteuerung, Methode – Lösungen – Anforderungen der Aufsicht*, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012, S. 15 – 35.
- Bartetzky, Peter* (Bankbetriebliche Risiken, 2012): Bankbetriebliche Risiken, in: *Bartetzky, Peter* (Hrsg.): *Praxis der Gesamtbanksteuerung, Methode – Lösungen – Anforderungen der Aufsicht*, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012, S. 36 – 83.
- Bartetzky, Peter* (Prozess der Gesamtbanksteuerung, 2012): Prozess der Gesamtbanksteuerung, in: *Bartetzky, Peter* (Hrsg.): *Praxis der Gesamtbanksteuerung, Methode – Lösungen – Anforderungen der Aufsicht*, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012, S. 141 – 160.
- Basel Committee on Banking Supervision* (Backtesting, 1996): Supervisory Framework for the Use of “Backtesting” in Conjunction with the Internal Models Approach to Market Risk Capital Requirements, <http://www.bis.org/publ/bcbs22.pdf>, (Zugriff 2017-05-11, 14:49 MEZ).
- Basel Committee on Banking Supervision* (Zinsänderungsrisiken, 2004): Principles for the Management and Supervision of Interest Rate Risk, <https://www.bis.org/publ/bcbs108.pdf>, (Zugriff 2017-03-27, 23:15 MEZ).
- Basel Committee on Banking Supervision* (Zinsänderungsrisiken, 2016): Interest rate risk in the banking book, <https://www.bis.org/bcbs/publ/d368.pdf>, (Zugriff 2017-03-27, 23:02 MEZ).
- Bäumel, Christoph* (Gesamtbanksteuerung, 2014): Steuerung des Gesamtbankergebnisses in der Praxis, in: *Zeranski, Stefan* (Hrsg.): *Gesamtbanksteuerung in der Praxis – im Kontext verschärfter regulatorischer Neuregelungen*, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2014, S. 183 – 209.

- Beck, Andreas, Lesko, Michael* (Copula, 2006): Zur Modellierung von Abhängigkeiten in der Bankpraxis – Copula-Funktionen zur Ermittlung des Gesamtbankrisikoprofils, in: Betriebswirtschaftliche Blätter, 12 (2006, Nr. 05, S. 289 – 293, <https://www.risknet.de/fileadmin/eLibrary/Copula-Gesamtbankrisikoprofil-Beck-2006.pdf>, (Zugriff 2017-05-07, 14:41 MEZ).
- Beck, Andreas, Lesko, Michael, Schlottmann, Frank, Wimmer, Konrad* (Copula, 2006): Copulas im Risikomanagement, in: ZfgK - Zeitschrift für das gesamte Kreditwesen, 59 (2006), Nr. 14 2006, S. 29 – 33, <https://www.risknet.de/fileadmin/eLibrary/Gillardon-Copulas-2006-4.pdf>, (Zugriff 2017-05-07, 14:41 MEZ).
- Bieg, Hartmut, Krämer, Gregor, Waschbusch, Gerd* (Bankenaufsicht, 2011): Bankenaufsicht in Theorie und Praxis, 4. Auflage, Frankfurt: Frankfurt School Verlag 2011.
- Biermann, Bernd* (Risikomanagement, 2002): Modernes Risikomanagement in Banken, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): Handbuch des Risikomanagements, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 103 – 125.
- Blömer, Stefan, Lindemann, Wibke* (SREP Banksteuerung, 2016): Auswirkungen des SREP auf die Banksteuerung – der Säule 1+ Ansatz, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 81 – 111.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 01, 2017): BVCSBU01 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 02, 2017): BVCSBU02 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 03, 2017): BVCSBU03 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 04, 2017): BVCSBU04 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 05, 2017): BVCSBU05 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 06, 2017): BVCSBU06 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 07, 2017): BVCSBU07 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 08, 2017): BVCSBU08 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 09, 2017): BVCSBU09 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Banken A-LZ 10, 2017): BVCSBU10 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 01, 2017): GDBR1 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 02, 2017): GDBR2 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 03, 2017): GDBR3 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 04, 2017): GDBR4 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 05, 2017): GDBR5 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 06, 2017): GDBR6 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 07, 2017): GDBR7 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 08, 2017): GDBR8 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 09, 2017): GDBR9 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Bundrendite-LZ 10, 2017): GDBR10 Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 01, 2017): EUSA1 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 02, 2017): EUSA2 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 03, 2017): EUSA3 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 04, 2017): EUSA4 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 05, 2017): EUSA5 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 06, 2017): EUSA6 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 07, 2017): EUSA7 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 08, 2017): EUSA8 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 09, 2017): EUSA9 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Swap-LZ 10, 2017): EUSA10 CMPL Curncy Index, PX\_BID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 01, 2017): BVCSBC01 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 02, 2017): BVCSBC02 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 03, 2017): BVCSBC03 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 04, 2017): BVCSBC04 Index, PX\_MID.

- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 05, 2017): BVCSBC05 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 06, 2017): BVCSBC06 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 07, 2017): BVCSBC07 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 08, 2017): BVCSBC08 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 09, 2017): BVCSBC09 Index, PX\_MID.
- Bloomberg* (Unternehmen BBB-LZ 10, 2017): BVCSBC10 Index, PX\_MID.
- Boka, Noel, Reuse, Svend, Frère, Eric* (implizite Optionen, 2015): Implizite Optionen: Knackpunkte der Modellvalidierung und der Risikoinventur, in: Bankpraktiker, 10 (2015), Nr. 10, S. 354 – 361.
- Bouchaud, Jean-Philippe, Potters, Marc* (Random Matrix Theory, 2009): Financial Applications of Random Matrix Theory: a short review, <https://arxiv.org/pdf/0910.1205.pdf>, (Zugriff 2017-03-20, 21:01 MEZ).
- Bricke, Thomas* (Moderne historische Simulation, 2016): Moderne historische Simulation: Abklingende Eintrittswahrscheinlichkeiten, in: Bankpraktiker, 11 (2016), Nr. 06, S. 211 – 216.
- Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (Rundschreiben, 2011): Rundschreiben 11/2011 (BA): Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch; Ermittlung der Auswirkungen einer plötzlichen und unerwarteten Zinsänderung, GZ: BA 55-FR 2232-2010/0001, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben\\_Bafin/2011\\_11\\_zinsaenderungsrisiken\\_rundschreiben.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben_Bafin/2011_11_zinsaenderungsrisiken_rundschreiben.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-03-28, 19:28 MEZ).
- Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (Allgemeinverfügung, 2015): Allgemeinverfügung: Festlegung der Quote für den Antizyklischen Kapitalpuffer, GZ: BA 51-AZB 1130-2015/0009, [https://www.bafin.de/SharedDocs/Veroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf\\_151228\\_allgvfg\\_antizyklischer\\_kapitalpuffer\\_ba.html?nn=7852116](https://www.bafin.de/SharedDocs/Veroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf_151228_allgvfg_antizyklischer_kapitalpuffer_ba.html?nn=7852116), (Zugriff 2017-04-02, 18:33 MEZ).
- Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (Anschreiben, 2016): Anschreiben zur Allgemeinverfügung: Anordnung von Eigenmittelanforderungen für Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch, GZ: BA 55-FR 2232-2016/0001, [https://www.bafin.de/ShareDocs/eroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf\\_161223\\_allgvfg\\_zinsaenderungsrisiko.html](https://www.bafin.de/ShareDocs/eroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf_161223_allgvfg_zinsaenderungsrisiko.html), (Zugriff 2017-04-02, 11:36 MEZ).
- Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht* (Allgemeinverfügung, 2016): Allgemeinverfügung: Anordnung von Eigenmittelanforderungen für Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch, GZ: BA 55-FR 2232-2016/0001, [https://www.bafin.de/ShareDocs/Veroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf\\_161223\\_allgvfg\\_zinsaenderungsrisiko.html](https://www.bafin.de/ShareDocs/Veroeffentlichungen/DE/Aufsichtsrecht/Verfuegung/vf_161223_allgvfg_zinsaenderungsrisiko.html), (Zugriff 2017-04-02, 11:36 MEZ).
- Campbell, John Y., Lo, Andrew W., MacKinlay, A. Craig* (Finanzökometrie, 1997): The Econometric of Financial Markets, Princeton, New Jersey, USA: Princeton University Press 2007.
- Capital Requirements Directive IV (CRD IV, 2013)*: Richtlinie 2013/36/EU des europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Zugang zur Tätigkeit von Kreditinstituten und die Beaufsichtigung von Kreditinstituten und Wertpapierfirmen, zur Änderung der Richtlinie 2002/87/EG und zur Aufhebung der Richtlinien 2006/48/EG und 2006/49/EG, <http://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/PDF/?uri=CELEX:32013L0036&from=DE>, (Zugriff 2017-03-08, 20:00 MEZ).
- Capital Requirements Regulation (CRR, 2013)*: Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 646/2012 Text von Bedeutung für den EWR, <http://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/PDF/?uri=CELEX:32013R0575&qid=1490132550665&from=en>, (Zugriff 2017-03-08, 20:00 MEZ).

- Cesare Di, Antonio, Stork, Philip A., Vries de, Casper G.* (Autocorrelated Hedge Fund Returns, 2010): Risk Measures of Autocorrelated Hedge Fund Returns, in: *Journal of Financial Econometrics*, 13 (2014), Nr. 04, S 868 – 895.
- Choudhry, Moorad, Moskovic, David, Wong, Max* (Fixed Income Markets, 2014): *Fixed Income Markets – Management, Trading and Hedging*, 2. Auflage, Singapur, Singapur: Wiley Finance Series 2014.
- Cont, Rama* (Volatility Clustering, 2005): *Volatility Clustering in Financial Markets: Empirical Facts and Agent–Based Models*, <http://www.proba.jussieu.fr/pageperso/ramacont/papers/clustering.pdf>, (Zugriff 2017-06-25, 12:29 MEZ).
- Cottin, Claudia, Döhler, Sebastian* (Risikoanalyse, 2013): *Risikoanalyse – Modellierung, Beurteilung und Management von Risiken mit Praxisbeispielen*, 2. Auflage, Wiesbaden: Springer Spektrum Verlag 2015.
- Cremers, Heinz* (Stochastik, 1998): *Stochastik für Banker*, 1. Auflage, Frankfurt: Bankakademie Verlag 1998.
- Cremers, Heinz* (Finanzmathematik, 1999): *Mathematik und Stochastik für Banker*, 2. Auflage, Frankfurt: Bankakademie Verlag 1999.
- Cremers, Heinz* (Value at Risk, 1999): *Value-at-Risk-Konzepte für Marktrisiken*, in: Hochschule für Bankwirtschaft (Hrsg.): *Value-at-Risk-Konzepte für Marktrisiken*, Arbeitsberichte der Hochschule für Bankwirtschaft, No. 17, <https://www.econstor.eu/bitstream/10419/27787/1/331055643.PDF>, (Zugriff 2017-05-14, 14:53, MEZ).
- Crouhy, Michel, Galai, Dan, Mark, Robert* (Modellrisiken, 1998): *Model Risk*, in: *Journal of Financial Engineering*, 7 (1998), Nr. 7, S. 267– 288.
- Danielsson, Jón* (Risikomessung, 2012): *Financial risk forecasting – The Theory and Practice of Forecasting Market Risk, with Implementation in R and MATLAB®*, 2. Auflage, Singapur, Singapur: Wiley Finance Series 2012.
- Danielsson, Jón, Jorgensen, Bjørn N. Samorodnitsky, Gennady, Sarma, Mandira de Vries, Casper G.* (Subadditivität, 2012): *Fat Tails, VaR and Subadditivity*, <http://www.riskresearch.org/files/DanielssonVriesJorgensenSamorodnitskyMandira2012.pdf>, (Zugriff 2017-04-17, 12:25 MEZ).
- Deans, Marc* (Backtesting, 2000): *Backtesting*, in: *Borodovsky, Lev, Lore, Marc* (Hrsg.): *Professional’s Handbook of Financial Risk Management*, Jordan Hill, Oxford, Vereinigtes Königreich Großbritannien: Butterworth-Heinemann 2000, S. 261 – 289.
- Deutsch, Hans-Peter* (Monte-Carlo-Simulation, 2002): *Monte-Carlo-Simulation in der modernen Finanzwelt*, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): *Handbuch des Risikomanagements*, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 373 – 427.
- Deutsche Bundesbank* (Bankbücher, 1999): *Rundschreiben 17/99: Zuordnung der Bestände und Geschäfte der Institute zum Handelsbuch und zum Anlagebuch (§ 1 Abs. 12 KWG, § 2 Abs. 11 KWG)*, [http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben\\_Bafin/1999\\_17\\_zuordnung\\_der\\_bestaende\\_und\\_geschaefte\\_der\\_institute\\_zum\\_handelsbuch\\_und\\_zum\\_anlagebuch.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben_Bafin/1999_17_zuordnung_der_bestaende_und_geschaefte_der_institute_zum_handelsbuch_und_zum_anlagebuch.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-01, 16:12 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Bankbücher, 2001): *Rundschreiben 1/2001: Grundsatz I – Modellierung des besonderen Kursrisikos*, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben\\_Bafin/2001\\_01\\_grundsatz\\_i\\_modellierung\\_des\\_besonderen\\_kursrisikos.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Rundschreiben_Bafin/2001_01_grundsatz_i_modellierung_des_besonderen_kursrisikos.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-01, 16:35 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Range of Practice, 2010): *“Range of Practice“ zur Sicherstellung der Risikotragfähigkeit bei deutschen Kreditinstituten*, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Marisk/2010\\_11\\_11\\_range\\_of\\_practice\\_sicherstellung\\_risikotragfaehigkeit.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Marisk/2010_11_11_range_of_practice_sicherstellung_risikotragfaehigkeit.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-08, 11:39 MEZ).

- Deutsche Bundesbank* (Risikotragfähigkeit, 2011): Aufsichtliche Beurteilung bankinterner Risikotragfähigkeitskonzepte, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Marisk/2011\\_12\\_07\\_aufsichtliche\\_beurteilung\\_bankinterner\\_risikotragfaehigkeitskonzepte.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Bankenaufsicht/Marisk/2011_12_07_aufsichtliche_beurteilung_bankinterner_risikotragfaehigkeitskonzepte.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-03-28, 21:45 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch, 2012): Die Rolle des „Baseler Zinsschocks“ bei der bankaufsichtlichen Beurteilung von Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch, in: Monatsbericht Juni 2012, 64. Jahrgang 2012, S. 55 – 65, [http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2012/2012\\_06\\_zinsschock.pdf%3F\\_\\_blob%3DpublicationFile](http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2012/2012_06_zinsschock.pdf%3F__blob%3DpublicationFile), (Zugriff 2017-03-10, 09:03 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Sicherstellung der Risikotragfähigkeit, 2013): Bankinterne Methoden zur Ermittlung und Sicherstellung der Risikotragfähigkeit und ihre bankaufsichtliche Bedeutung, in: Monatsbericht März 2013, 65. Jahrgang 2013, S. 31 – 45, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2013/2013\\_03\\_risikotragfaehigkeit.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2013/2013_03_risikotragfaehigkeit.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-03-08, 23:11 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Basel III, 2013): Die Umsetzung von Basel III in europäisches und nationales Recht, in: Monatsbericht Juni 2013, 65. Jahrgang 2013, S. 57 – 73, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2013/2013\\_06\\_umsetzung\\_basel\\_3n.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Monatsberichtsaufsaetze/2013/2013_06_umsetzung_basel_3n.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-02, 18:13 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Risiken im Bankensektor, 2015): Risiken im deutschen Bankensektor, in: *Deutsche Bundesbank* (Hrsg.): Finanzstabilitätsbericht 2015, [http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2015\\_finanzstabilitaetsbericht.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2015_finanzstabilitaetsbericht.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-09, 15:45 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Makroökonomisches Umfeld, 2016): Makroökonomisches und finanzielles Umfeld begünstigt Aufbau von Risiken, in: *Deutsche Bundesbank* (Hrsg.): Finanzstabilitätsbericht 2016, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2016\\_finanzstabilitaetsbericht.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2016_finanzstabilitaetsbericht.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-02, 19:42 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (Risiken im Bankensektor, 2016): Risiken im Bankensektor gestiegen, in: *Deutsche Bundesbank* (Hrsg.): Finanzstabilitätsbericht 2016, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2016\\_finanzstabilitaetsbericht.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Veroeffentlichungen/Finanzstabilitaetsberichte/2016_finanzstabilitaetsbericht.pdf?__blob=publicationFile), (Zugriff 2017-04-02, 19:42 MEZ).
- Deutsche Bundesbank* (EZB Leitzins, 2017): Zinssatz der EZB für Hauptrefinanzierungsgeschäfte / Stand am Monatsende, [http://www.bundesbank.de/Navigation/DE/Statistiken/Zeitreihen\\_Datenbanken/Geld\\_und\\_Kapitalmaerkte/geld\\_und\\_kapitalmaerkte\\_list\\_node.html?listld=www\\_s510\\_mb01](http://www.bundesbank.de/Navigation/DE/Statistiken/Zeitreihen_Datenbanken/Geld_und_Kapitalmaerkte/geld_und_kapitalmaerkte_list_node.html?listld=www_s510_mb01), (Zugriff 2017-04-08, 16:37 MEZ).
- Dombret, Andreas* (Niedrigzinsumfeld, 2017a): Der Kuchen wird kleiner. Konsolidierung und Neuausrichtung im deutschen Bankensektor, Rede auf der 5. Jahreskonferenz Gesamtbanksteuerung der Frankfurt School of Finance & Management, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017\\_03\\_30\\_dombret.html?view=render%5BDruckversion%5D](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017_03_30_dombret.html?view=render%5BDruckversion%5D), (Zugriff 2017-04-09, 14:56 MEZ).
- Dombret, Andreas* (Niedrigzinsumfeld, 2017b): Verabschiedung von Dr. Alexander Erdland als Vorstandsvorsitzender der W&W, Rede vom 16.03.2017 in Stuttgart, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017\\_03\\_16\\_dombret.html?view=render%5BDruckversion%5D](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017_03_16_dombret.html?view=render%5BDruckversion%5D), (Zugriff 2017-04-09, 15:20 MEZ).
- Dreger, Christian, Kosfeld, Reinhold, Eckey, Hands-Friedrich* (Ökonometrie, 2014): Ökonometrie – Grundlagen – Methoden – Beispiele, 5. Auflage, Wiesbaden: Springer Gabler 2014.
- Drosdzol, Adam* (Zinsmanagement, 2004): Zinsmanagement mit Zinsstrukturmodellen, (zugl. Diss. Universität Siegen 2004) in: *Wiedemann, Arnd*, (Hrsg.): Zinsmanagement mit Zinsstrukturmodellen, Frankfurt: Bankakademie Verlag 2004.

- Duckheim, Stefan* (Bankaufsichtliche Grundlagen, 2014): Nationale Regulierung der Gesamtbanksteuerung und Risikotragfähigkeit, in: *Zeranski, Stefan* (Hrsg.): Gesamtbanksteuerung in der Praxis – im Kontext verschärfter regulatorischer Neuregelungen, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2014, S. 42 – 73.
- Ebeling, Frank, Mitschele, Andreas* (Historische Simulation, 2010): Strategische Zinsrisikosteuerung im aktuellen Marktumfeld, in: *ZfgK - Zeitschrift für das gesamte Kreditwesen*, 63 (2010), Nr. 5, S. 237 – 241.
- Eddari, Abderr azak* (Risikomaße, 2007): Risikomaße in der Finanzmathematik, <http://ubm.opus.hbz-nrw.de/volltexte/2008/1667/pdf/diss.pdf>, (Zugriff 2017-04-26, 16:22 MEZ), (zugl. Diss. Johannes-Gutenberg-Universität Mainz 2007).
- Elliott, Robert J., Kopp, P. Ekkehard* (Finanzmarktmathematik, 1999): Mathematics of Financial Markets, New York, Vereinigte Staaten von Amerika: Springer Science Verlag 1999.
- Enthofer, Hannes, Haas, Patrick* (Gesamtbanksteuerung, 2016): Asset Liability Management/Gesamtbanksteuerung, Wien, Österreich: Linde Verlag 2016.
- Eun, Cheol S., Resnick, Bruce G.* (International Finance, 2014): International Finance, 7. Auflage, Maidenhead, Berkshire, Vereinigtes Königreich Großbritannien: McGraw Hill Education Verlag 2014.
- Fähnrich, Christian, Manns, Denise* (Zinsbuchsteuerung, 2008): Konzeptionsentwicklung im Treasury-Management für Banken: Unter besonderer Berücksichtigung der Zinsbuchsteuerung, Hamburg: Diplomica Verlag 2008.
- Fama, Eugene F.* (Informationseffizienz, 1970): Efficient capital markets: A review of theory and empirical work, in: *Journal of Finance*, 25. Jahrgang, S. 383-417.
- Federal Reserve Bank of New York* (Leitzins, 2017): Federal-Funds-Rate-Zielband, <https://apps.newyorkfed.org/markets/autorates/fed%20funds>, (Zugriff 2017-04-08, 14:49 MEZ).
- Feger, Melanie, Marek, Michael* (Varianz-Kovarianz-Verfahren, 2002): Die Quantifizierung des Zinsstrukturrisikos mit Hilfe des Value-at-Risk-Konzeptes, [http://www.risknet.ch/fileadmin/eLibrary/Value at Risk-Feger-Marek-2002.pdf](http://www.risknet.ch/fileadmin/eLibrary/Value%20at%20Risk-Feger-Marek-2002.pdf), (Zugriff 2017-04-30, 14:54 MEZ).
- Fiebig, Mathias, Heithecker, Dirk* (Risikomodellierung, 2015): Aufbau und Durchführung einer ganzheitlichen Risikoinventur nach den MaRisk, in: *Janßen, Stefan, Riediger, Henning* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikoinventur, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2015, S. 189 – 233.
- Fischer, Christoph, Rudolph, Bernd* (Transformationsfunktionen, 2000): Grundformen von Finanzsystemen, in: von Hagen, Jürgen, von Stein, Johann Heinrich (Hrsg.): Geld-, Bank- und Börsenwesen, 40. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2000, S. 371 – 446.
- Franke, Jürgen, Hürdle, Wolfgang, Hafner, Matthias* (Finanzmarktstatistik, 2004): Einführung in die Statistik der Finanzmärkte, 2. Auflage, Heidelberg: Springer Verlag 2004.
- Frey, Thomas, Kurth, Michael* (Spreadrisiko, 2012): Umfassendes Werkzeug – Kreditportfoliomodell für Eigengeschäfte: Erfolgsfaktoren der Implementierung, in: *Bankinformation*, 40 (2012), Nr. 10, S. 48 – 51.
- Genschel, Ulrike, Becker, Claudia* (Schließende Statistik, 2005): Schließende Statistik – Grundlegende Methoden, Heidelberg: Springer Verlag 2005.
- Glaser, C.* (Operationelle Risiken, 2015): Risikomanagement im Leasing – Grundlagen, rechtlicher Rahmen und praktische Umsetzung, Wiesbaden: Springer Gabler 2015.
- Gleißner, Werner* (Risikomanagement, 2011): Grundlagen des Risikomanagements im Unternehmen – Controlling, Unternehmensstrategie und wertorientiertes Management, 2. Auflage, München: Vahlen Verlag 2011.
- Graf, Thomas* (Zinsrisikomanagement, 2002): Zinsrisikomanagement mit dem Zinselastizitätenkonzept am Beispiel einer Sparkasse, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): Handbuch des Risikomanagements, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 257 – 290.



- Gromova-Schneider, Anastasia* (Bankaufsichtliche Grundlagen, 2014): Bankaufsichtliche Grundlagen der Gesamtbanksteuerung und der Bankgeschäftsmodelle, in: *Zeranski, Stefan* (Hrsg.): Gesamtbanksteuerung in der Praxis – im Kontext verschärfter regulatorischer Neuregelungen, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2014, S. 5 – 41.
- Gruber, Walter* (Diskontkurven, 2002): Aufbau und Interpolation von Diskontkurven, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): Handbuch des Risikomanagements, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 331 – 351.
- Hackl, Peter* (Ökonometrie, 2013): Einführung in die Ökonometrie, 2. akt. Auflage, München: Pearson Verlag 2013.
- Hager, Peter* (Historische Simulation, 2004): Value at Risk mit der Historischen Simulation, [http://www.riskwiki.de/risikomessung/Value at Risk-mit-der-Historischen-simulation.html](http://www.riskwiki.de/risikomessung/Value%20at%20Risk-mit-der-Historischen-simulation.html), Zugriff 2017-04-19, 22:27 MEZ).
- Hager, Peter* (Varianz-Kovarianz-Modell, 2004): VaR-Verfahren, [https://www.risknet.de/fileadmin/template\\_risknet/images\\_content/Methoden/VaR-Verfahren\\_RiskNET.pdf](https://www.risknet.de/fileadmin/template_risknet/images_content/Methoden/VaR-Verfahren_RiskNET.pdf), (Zugriff 2017-04-24, 22:03 MEZ).
- Hager, Peter, Romeike, Frank* (Varianz-Kovarianz-Verfahren, 2010): Was ist das Varianz-Kovarianz-Modell?, in: *Risk, Compliance & Audit*, 02 (2010), Nr. 5, S. 10 – 11.
- Hahn, Gunther* (Copula, 2012): Portfoliobildung mit Copulas, in: *Hockmann, Heinz-Josef, Thießen, Friedrich* (Hrsg.): Investmentbanking, 3. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012, S. 181 - 186.
- Handschocher, Nicole* (Zinsrisikomessung, 2014): Steuerung der Marktpreisrisiken, in: *Zeranski, Stefan* (Hrsg.): Gesamtbanksteuerung in der Praxis – im Kontext verschärfter regulatorischer Neuregelungen, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2014, S.461 - 488.
- Hanenberg, Ludger* (Risikotragfähigkeit, 2016): Europäische Vorgaben zur Umsetzung des SREP, BaFin Konferenz: Neues SREP Konzept der Aufsicht am 04.05.2016, [https://www.bafin.de/SharedDocs/Downloads/DE/Rede\\_Vortrag/dl\\_160504\\_Neues\\_SREP\\_Konzept\\_vortrag\\_1.pdf?jsessionid=2EF1A663411EB948DEA0D4705D713618.1\\_cid390?\\_\\_blob=publicationFile&v=1](https://www.bafin.de/SharedDocs/Downloads/DE/Rede_Vortrag/dl_160504_Neues_SREP_Konzept_vortrag_1.pdf?jsessionid=2EF1A663411EB948DEA0D4705D713618.1_cid390?__blob=publicationFile&v=1), (Zugriff 2017-04-06, 21:39 MEZ).
- Hanser, Patrik, Disch, Wolfgang* (Autokorrelation LPE, 2016): Verteilungs- und Performance-Eigenschaften von Listed Private Equities, in: *Corporate Finance*, 07 (2016), Nr. 5, S. 162 – 169.
- Hassler, Uwe* (Zeitreihenanalyse, 2007): Stochastische Integration und Zeitreihenmodellierung – Eine Einführung mit Anwendungen aus Finanzierung und Ökonometrie, in: *Detle, Holger, Härdle, Wolfgang* (Hrsg.): Schriftenreihe Statistik und ihre Anwendungen, Heidelberg: Springer Verlag 2007.
- Hatzinger, Reinhold, Hornik, Kurt, Nagel, Herbert, Maier, Marco J.* (R, 2014): R – Einführung durch angewandte Statistik, 2. Auflage, München: Pearson Verlag 2014.
- Haug, Matthias* (Risikotragfähigkeit, 2016): Ableitung eines Risikotragfähigkeit-Konzeptes aus der Strategie, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 157 – 172.
- Hedderich, Jürgen, Sachs, Lothar* (Statistik, 2016): Angewandte Statistik – Methodensammlung mit R, 15. Auflage, Heidelberg: Springer Spektrum Verlag 2015.
- Heinrich, Markus* (Autokorrelation Dow Jones, 2014): Autokorrelation oder die Problematik, Risiken für 250 Tage zu quantifizieren, in: *Eller, Roland, Heinrich, Markus, Perrot, René, Reif, Markus* (Hrsg.): repeat Jahrbuch Treasury & Private Banking 2014, Zossen: Roland Eller Training GmbH, 2014, S. 383 – 394.
- Heinrich, Markus* (Methodenfragen, 2010): Methodenfragen zum Risikotragfähigkeitskonzept – Nachkommastellen und andere Modellfehler der Risikomessung, in: *Betriebswirtschaftliche Blätter*, 16 (2010), Nr. 04, S. 207 – 210.

- Heinzel, Detlev, Knobloch, Peter, Lorenz, Björn* (Risikomanagement, 2002): Modernes Risikomanagement – Steuerung von Kassainstrumenten und Derivaten im Bankbetrieb, in: *Eller, Roland* (Hrsg.): Modernes Risikomanagement – Steuerung von Kassainstrumenten und Derivaten im Bankbetrieb, Wiesbaden: Gabler Verlag 2002, S. 1 – 256.
- Hellbrück, Reiner* (Angewandte Statistik, 2011): Angewandte Statistik mit R: Eine Einführung für Ökonomen und Sozialwissenschaftler, 2. Auflage, Wiesbaden: Gabler Verlag 2011.
- Henkel, Knut, Kühne, Jan, Storch, Daniel, Waitz, Daniela* (Risikomanagement, 2010): Risikomanagement, in: *Eller, Roland, Heinrich, Markus, Perrot, René, Reif, Markus* (Hrsg.): Kompaktwissen Risikomanagement, Wiesbaden: Gabler Verlag 2010, S. 27 – 46.
- Henking, Andreas, Bluhm, Christian, Fahrmeir, Ludwig* (Kreditrisikomessung, 2006): Kreditrisikomessung – Statistische Grundlagen, Methoden und Modellierung, Heidelberg: Springer Verlag 2006.
- Hlawatsch, Stefan, Reiching, Peter* (Copula, 2010): Konstruktion und Anwendung von Copulas in der Finanzwirtschaft, in: Otto-von-Guericke-Universität Magdeburg, Working Paper Series, No. 16/2010, [http://www.fww.ovgu.de/fww\\_media/femm/femm\\_2010/2010\\_16.pdf](http://www.fww.ovgu.de/fww_media/femm/femm_2010/2010_16.pdf), (Zugriff 2017-05-06, 15:45 MEZ).
- Holey, Thomas, Wiedemann, Armin* (Mathematik, 2016): Mathematik für Wirtschaftswissenschaftlicher, 4. Auflage, Wiesbaden: Springer Gabler 2016.
- Hull, John C.* (Risikomanagement, 2014): Risikomanagement – Banken, Versicherungen und andere Finanzinstitutionen, 3. Auflage, Hallbergmoos: Pearson Verlag 2014.
- Hundt, Steffen* (Informationsgehalt Credit Ratings, 2015): Informationsgehalt von Credit Ratings – Eine empirische Analyse europäischer Aktien- und Anleihemärkte, Wiesbaden: Springer Gabler 2015, (zugl. Diss. Technische Universität Bergakademie Freiberg 2015).
- Huschens, Stefan* (Historische Simulation, 2000): Value-at-Risk-Berechnung durch Historische Simulation, in: Technische Universität Dresden, Fakultät für Wirtschaftswissenschaften: Dresdner Beiträge zu Quantitativen Verfahren, Nr. 30/2000, <https://wwqvs.file3.wcms.tu-dresden.de/publ/varhist.pdf>, (Zugriff 2017-04-20, 20:38 MEZ).
- Jackson, Mary, Staunton, Mike* (Finanzmathematik, 2010): Advanced modelling in finance using Excel and VBA, Chichester, West Sussex, Vereinigtes Königreich Großbritannien: Wiley Finance 2010.
- Jendruschewitz, Boris* (Value at Risk, 1999): Value at Risk – Ein Ansatz zum Management von Marktrisiken in Banken, in: *Heidorn, Thomas, Cremers, Heinz, Moormann, Jürgen* (Hrsg.): Diskussionsbeiträge zur Bankbetriebslehre, Band 7: Value at Risk – Ein Ansatz zum Management von Marktrisiken in Banken, 2. Auflage, Frankfurt: Bankakademie Verlag 1999.
- Jorion, Philippe* (Value at Risk, 2007): Value at Risk – The New Benchmark for Managing Financial Risk, 3. Auflage, New York, Vereinigte Staaten von Amerika: McGraw Hill Education Verlag 2007.
- J.P. Morgan, Reuters Ltd* (RiskMetricsTM, 1996): RiskMetricsTM – Technical Document, <https://www.msci.com/documents/10199/5915b101-4206-4ba0-ae2-3449d5c7e95a>, (Zugriff 2017-03-07, 20:31 MEZ).
- Kemp, Malcolm H. D.* (fat tails, 2011): Extreme Events - Robust Portfolio Construction in the Presence of Fat Tails, Chichester, West Sussex, Vereinigtes Königreich Großbritannien: Wiley Finance 2011.
- Klausnitzer, Kevin* (Risikomessverfahren, 2015): Quantifizierung der Schadenshöhe und der Eintrittswahrscheinlichkeit, in: *Janßen, Stefan, Riediger, Henning* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikoinventur, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2015, S. 153 – 162.
- Klenner, Oliver, Tangemann, Andreas* (Historische Simulation, 2013): Marktpreis- und Zinsrisikomessverfahren, in: *Kühn Stefan* (Hrsg.): MaRisk-konforme Risikomessverfahren, Prognosegüte – Validierungsprozess – Modellschwächen, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2013, S. 103 – 153.



- Klomfaß, Christian, Müller, Markus* (Steuerungsansätze Risikotragfähigkeit, 2016): Steuerungsansätze zur Herleitung der Risikotragfähigkeit, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): *Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit*, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 339 – 375.
- Kohlscheen, Emanuel, Avalos Fernando H., Schrimpf, Andreas* (Random Walk, 2016): When the Walk is not Random: Commodity Prices and Exchange Rates, BIS Working Papers Nr. 551 (März 2016), <http://www.bis.org/publ/work551.pdf>, (Zugriff 2017-03-07, 19:32 MEZ).
- Köhne, Marc Felix* (Risikodefinition, 2007): Risikoartenübergreifende Steuerung in Industrieunternehmen, in: *Kaiser, Thomas* (Hrsg.): *Wettbewerbsvorteil Risikomanagement – Erfolgreiche Steuerung der Strategie-, Reputations- und operationellen Risiken*, Berlin: Erich Schmidt Verlag 2007, S. 307 – 326.
- Konjetzky, Helmut, Kratz, Karlheinz* (Zinsstrukturanalyse, 2002): Quantitative Zinsstrukturanalyse und Konsequenzen für das Fixed-Income-Trading, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): *Handbuch des Risikomanagements*, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 149 – 173.
- Kreiß, Jens-Peter, Neuhaus, Georg* (Zeitreihenanalyse, 2006): Einführung in die Zeitreihenanalyse, Heidelberg: Springer Verlag 2006.
- Kübler, Bernhard, Ruckdeschel, Peter* (Autokorrelation Marktpreisrisikomessung, 2013): Autokorrelationseffekte bei der Messung von Marktpreisrisiken (30. September 2013), [https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=2330334](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=2330334), (Zugriff 2017-03-07, 21:21 MEZ).
- Lindemann, Jens* (Rechnungslegung und Kapitalmarkt, 2004): Rechnungslegung und Kapitalmarkt – Eine theoretische und empirische Analyse (zugl. Diss. Justus-Liebig-Universität Gießen, 2004), in: *Baetge, Jörg, Kirsch, Hans-Jürgen, Thiele, Stefan* (Hrsg.): *Rechnungslegung und Kapitalmarkt – Eine theoretische und empirische Analyse*, Reihe: Rechnungslegung und Wirtschaftsprüfung, Band 5, Lohmar: Josef Eul Verlag 2004.
- Longstaff, Francis A.* (Flight-to-Liquidity, 2002): The Flight-to-Liquidity Premium in U.S. Treasury Bond Prices, in: *The Journal of Business*, 77 (2004), Nr. 03, S. 511 – 526.
- Lübke, Karsten, Vogt, Martin* (Wirtschaftsstatistik, 2014): Angewandte Wirtschaftsstatistik, FOM-Edition, Wiesbaden: Springer Gabler 2014.
- Mandelbrot, Benoit* (Volatility Clustering, 1963): The Variation of Certain Speculative Prices, in: *The Journal of Business*, 36 (1963), Nr. 4, S.
- Mankiw, N. Gregory, Taylor, Mark P.* (Volkswirtschaftslehre, 2012): Grundzüge der Volkswirtschaftslehre, 5. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012.
- Maul, Thomas, Mirkow, Radoslava* (Modellierung, 2013): Risikomodellierung in Finanzinstituten – Validierung von Modellen, in: *Risiko Manager*, 8 (2013), Nr. 13, S. 1 sowie S. 6 – 10.
- Mayer, Christoph* (Zinsstrukturkurve, 2009): Die Entwicklung der Zinsstrukturkurve – eine Analyse homogener affiner Mehrfaktormodelle auf Basis des Kalman.Filters, Wiesbaden: Gabler Verlag 2009, (zugl. Diss. Universität Mannheim 2008).
- Mazzoni, Thomas* (Zeitreihe, 2010): Begleitskript zur Zeitreihenanalyse und empirischen Kapitalmarktforschung, Version 01/2010, [http://www.fernuni-hagen.de/imperia/md/content/l5\\_statistik/multimedia/eigene/zeitreihenskript\\_jan\\_2010.pdf](http://www.fernuni-hagen.de/imperia/md/content/l5_statistik/multimedia/eigene/zeitreihenskript_jan_2010.pdf), (Zugriff 2017-05-13, 14:54 MEZ).
- Mehmke, Fabian, Cremers, Heinz, Pachham, Natalie* (Marktpreisrisikomessung, 2012): Validierung von Konzepten zur Messung des Marktrisikos – insbesondere des Value at Risk und des Expected Shortfall, Frankfurt School – Working Paper Series, Nr. 192, <https://www.econ.stor.eu/bitstream/10419/60503/1/721270417.pdf>, (Zugriff 2017-04-24, 19:04 MEZ).
- Memmel, Christoph, Seymen, Atılım, Teichert, Max* (interest rate risk, 2016): Banks' interest rate risk and search for yield: a theoretical rationale and some empirical evidence, in: Deutsche Bundesbank, Discussion Paper No 22/2016, <https://www.bundesbank.de/Redaktion/EN>

- /Downloads/Publications/Discussion\_Paper\_1/2016/2016\_06\_28\_dkp\_22.pdf?\_\_blob=publicationFile, (Zugriff 2017-08-12, 12:15 MEZ).
- Mishkin, Frederic S.* (Informationseffizienz, 1978): Efficient-Markets Theory: Implications for Monetary Policy, in: Brookings Papers on Economic Activity, Economic Studies Program, The Brookings Institution, 9. Jahrgang Nr. 3, S. 707-752, [https://www.brookings.edu/wp-content/uploads/2016/11/1978c\\_bpea\\_mishkin.pdf](https://www.brookings.edu/wp-content/uploads/2016/11/1978c_bpea_mishkin.pdf), (Zugriff 2017-03-13, 19:40 MEZ).
- Müller, Thomas* (Finanzrisiken, 2013): Finanzrisiken in der Assekuranz – Moderne Finanz- und Risikokonzepte in der Versicherungswirtschaft, in: *Luderer, Bernd* (Hrsg.): Studienbücher Wirtschaftsmathematik, Wiesbaden: Springer Gabler Verlag 2013.
- Neumann, Frank* (Risikobestimmung, 2015): Bestimmung und Abgrenzung von Risiken unter Beachtung von Wechselwirkungen, in: *Janßen, Stefan, Riediger, Henning* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikoinventur, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2015, S. 101 – 117.
- Neusser, K.* (Zeitreihenanalyse, 2011): Zeitreihenanalyse in den Wirtschaftswissenschaften, 3. Auflage, Wiesbaden: Vieweg + Teubner Verlag 2011.
- Oehlich, Marcus* (Wissenschaftlich Arbeiten, 2015): Wissenschaftliches Arbeiten und Schreiben, Wiesbaden: Springer Gabler 2015.
- Oesterreichische Nationalbank* (Zinsänderungsrisiko, 2008): Leitfaden zum Management des Zinsrisikos im Bankbuch, [https://www.oenb.at/dam/jcr:04a628e2.../leitfaden\\_zrs\\_screen\\_tcm14-83154.pdf](https://www.oenb.at/dam/jcr:04a628e2.../leitfaden_zrs_screen_tcm14-83154.pdf), (Zugriff 2017-03-27, 21:57 MEZ).
- Ott, Christine* (Informationseffizienz Aktienmarkt, 2011): Der Informationsgehalt von Credit Ratings am deutschen Aktienmarkt – Eine empirische Untersuchung, Wiesbaden: Springer Gabler 2011, (zugl. Diss. Universität Göttingen 2011).
- Pankoke, Tim, Petersmeier, Kerstin* (Unternehmensbewertung, 2009): Der Zinssatz der Unternehmensbewertung, in: *Schacht, Ulrich, Fackler, Matthias* (Hrsg.): Praxishandbuch Unternehmensbewertung – Grundlagen, Methoden, Fallbeispiele, 2. Auflage, Wiesbaden: Gabler 2009, S. 107 – 138.
- parcIT GmbH* (KPM-EG, o. J.): Modul „Kreditportfoliomodell für Eigengeschäfte“ Bewertung von Migrations- und Spreadrisiken in okular ZIABRIS, <http://www.parcit.de/service/download/#>, (Zugriff 2017-03-27, 20:38 MEZ).
- Pesaran, M. Hashem* (Zeitreihenökometrie, 2015): time series and panel data econometrics, Oxford, Vereinigtes Königreich Großbritannien: Oxford University Press 2015.
- Prinzler, Ralf* (Historische Simulation, 2001): Value-at-Risk-Schätzung mit Gauß'schen Mischverteilungen und künstlichen neuronalen Netzen, München: Herbert Utz Verlag 2001 (zugl. Diss. Technische Universität Dresden 2000).
- Quell, Peter* (Risikomodellierung, 2013): Alternative Risikomodelle, in: *Kühn Stefan* (Hrsg.): MaRisk-konforme Risikomessverfahren, Prognosegüte – Validierungsprozess – Modellschwächen, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2013, S. 154 – 165.
- Quell, Peter* (Modellrisiko, 2013): Grundsätzliche Aspekte des Modellrisikos, in: *Martin, Marcus. R. W., Quell, P., Wehn, Carsten S.* (Hrsg.): Modellrisiko und Validierung von Risikomodelnen – Regulatorische Anforderungen, Verfahren, Methoden und Prozesse, Köln: Bank-Verlag, 2013, S. 15 – 32.
- Quell, Peter* (Modellrisiko Marktpreisrisiken, 2013): Modellrisiken im Handelsbuch, in: *Martin, Marcus. R. W., Quell, P., Wehn, Carsten S.* (Hrsg.): Modellrisiko und Validierung von Risikomodelnen – Regulatorische Anforderungen, Verfahren, Methoden und Prozesse, Köln: Bank-Verlag, 2013, S. 211 – 247.
- Rassat, Thomas* (Zinsänderungsrisiken, 2013): Management und Überwachung von Zinsänderungsrisiken aus Sicht der Bankenaufsicht, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Zinsrisikomanagement, 2. Auflage, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2012, S. 23 – 87.

- Rau-Bredow, Hans* (Value at Risk, 2001): Überwachung von Marktpreisrisiken durch Value at Risk, in: *Wirtschaftswissenschaftliches Studium (WiSt)*, 30 (2001), S. 315 -319.
- Reitz, Stefan* (Skalierung mit der Polynomfunktion, 2011): Skalierung von Konfidenzniveaus bei der Value-at-Risk-Schätzung von Marktpreisrisiken, [http://www.lplusi.de/dokumente/1\\_plus\\_i\\_fachbeitrag\\_VaR\\_sr.pdf](http://www.lplusi.de/dokumente/1_plus_i_fachbeitrag_VaR_sr.pdf), (Zugriff 2017-06-25, 14:27 MEZ).
- Reitz, Stefan* (Finanzmathematik, 2011): *Mathematik in der modernen Finanzwelt – Derivate, Portfoliomodelle und Ratingverfahren*, Wiesbaden: Vieweg + Teubner Verlag 2011.
- Reuse, Svend* (Korrelationen, 2011): *Korrelationen in Extremsituationen – Eine empirische Analyse des deutschen Finanzmarktes mit Fokus auf irrationales Marktverhalten*, Wiesbaden: Gabler Verlag, 2011 (zugl. Diss. Masaryk Universität Brunn, Tschechien, 2010).
- Reuse, Svend* (Definition Zinsänderungsrisiko, 2012): Definition und Ausprägung des Zinsänderungsrisikos, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): *Zinsrisikomanagement*, 2. Auflage, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2012, S. 9 – 20.
- Reuse, Svend, Svoboda, Martin, Zureck, Alexander* (Autokorrelation PX, 2014): Czech PX: Efficiency Analysis, Autocorrelations and Risk Quantification, in: *Čulík, Miroslav* (Hrsg.): *Managing and Modelling of Financial Risks, 7<sup>th</sup> International Scientific Conference, Proceedings (Part. III.)*, Ostrava, Tschechische Republik: VŠB-Technical University of Ostrava, S. 676 – 683; [https://www.ekf.vsb.cz/export/sites/ekf/rmfr/cs/sbornik/Soubory/Part\\_II.pdf](https://www.ekf.vsb.cz/export/sites/ekf/rmfr/cs/sbornik/Soubory/Part_II.pdf), (Zugriff 2017-03-11, 10:16 MEZ).
- Reuse, Svend* (Autokorrelation, 2015): Kritische Analyse von Risikomodelle – Möglichkeiten zur empirischen Forschung, in: *Frère, Eric, Reuse, Svend* (Hrsg.): *Risk- und Investmentmanagement am Finanz- und Kapitalmarkt, Tagungsband 7. Forschungsforum Finance*, Essen: MA Akademie Verlags- und Druck-Gesellschaft mbH, 2015, S. 44 – 61.
- Reuse, Svend* (Vergleich Steuerungskonzepte, 2016): Periodische versus wertorientierte Zinsbuchsteuerung im Kontext des Niedrigzinsumfelds, in: *ZfgK - Zeitschrift für das gesamte Kreditwesen*, 69 (2016), Nr. 3, S. 138 – 142.
- Reuse, Svend* (Allgemeinverfügung, 2016): Neue Allgemeinverfügung zum Zinsänderungsrisiko vom 23.12.2016, in: *Bankpraktiker*, 11 (2016), Nr. 2, S. 23 – 26.
- Reuse, Svend, Rüder, Annika, Boka, Noel* (Copula, 2017): Copulas in der Marktpreisrisikosteuerung: Ein aktuelles Modellierungsbeispiel, in: *Bankpraktiker*, 12 (2017), Nr. 3, S. 80 – 86.
- Riediger, Henning* (Risikomessverfahren, 2013): Aufsichtsrechtliche und gesetzliche Anforderungen an Risikomessmethoden, in: *Kühn Stefan* (Hrsg.): *MaRisk-konforme Risikomessverfahren, Prognosegüte – Validierungsprozess – Modellschwächen*, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2013, S. 39 – 75.
- Rolfes, Bernd* (Gesamtbanksteuerung, 2008): *Gesamtbanksteuerung – Risiken ertragsorientiert steuern*, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2008.
- Ronning, Gerd* (Empirische Wirtschaftsforschung, 2005): *Statistische Methoden in der empirischen Wirtschaftsforschung*, Münster: LIT Verlag 2005.
- Rosenow, Bernd* (Random Matrix Theory, 2005): Lecture 1: Random Matrix Theory for Financial Markets, [https://storage.sg.ethz.ch/workshops/Summerschool\\_05/Talks/Rosenow\\_1.pdf](https://storage.sg.ethz.ch/workshops/Summerschool_05/Talks/Rosenow_1.pdf), (Zugriff 2017-03-20, 20:01 MEZ).
- Rudolf, Markus* (Zinsstrukturmodelle, 2000): *Zinsstrukturmodelle*, Heidelberg: Springer Verlag 2000.
- Ruiz de Vargas, Santiago* (Marktrisikoprämie, 2012): Bestimmung der Historischen Marktrisikoprämie im Rahmen von Unternehmensbewertungen – Arithmetisches oder geometrisches Mittel, in: *Der Betrieb*, 65 (2012), Nr. 15, S. 813 – 819.
- Saxinger, Raimund* (Risikomaße, 2002): Traditionelle und neuere Risikomaße im Asset-Management, in: *Eller, Roland, Gruber, Walter, Reif, Markus* (Hrsg.): *Handbuch des Risikomanagements*, 2. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2002, S. 737 – 753.

- Schierenbeck, Henner, Lister, Michael, Kirmße, Stefan* (Ertragsorientiertes Bankmanagement II, 2008): Ertragsorientiertes Bankmanagement – Band 2: Risiko-Controlling und integrierte Rendite-/Risikosteuerung, 9. Auflage, Wiesbaden: Gabler Verlag, 2008.
- Schierenbeck, Henner, Lister, Michael, Kirmße, Stefan* (Ertragsorientiertes Bankmanagement I, 2014): Ertragsorientiertes Bankmanagement – Band 1: Messung von Rentabilität und Risiko im Bankgeschäft, 9. Auflage, Wiesbaden: Gabler Verlag, 2014.
- Schindler, Alexander* (Risikomodelle, 2009): Trügerische Sicherheit durch Risikomodelle, in: *ZfgK - Zeitschrift für das gesamte Kreditwesen*, 62 (2009), Nr. 16, S. 770 – 772.
- Schmid, Friedrich, Trede, Mark* (Finanzmarktstatistik, 2006): Finanzmarktstatistik, Heidelberg: Springer Verlag 2006.
- Seeger, Simone* (Risikomessung, 2016): Marktpreisrisiko inkl. Zinsänderungsrisiko, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 527 – 568.
- Seuthe, Andreas* (Risikotragfähigkeit, 2016): Regulatorische Rahmenbedingungen zur Risikotragfähigkeit, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Praktikerhandbuch Risikotragfähigkeit, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2016, S. 15 – 80.
- Sievi, Christian R, Wegner, Olaf, Freundorfer, Elena* (Marktpreisrisiken, 2011): Integration von Marktpreisrisiken, Stuttgart: deutscher Sparkassenverlag, 2011.
- Six, Timo* (Illiquidität, 2016): Investitionen in Illiquidität: Quantifizierung bankspezifischer (Il-)Liquiditätsprämien und deren Integration in die interne Steuerungsarchitektur, (zugl. Diss. Universität Siegen 2015) in: *Wiedemann, Arnd*, (Hrsg.): Investitionen in Illiquidität: Quantifizierung bankspezifischer (Il-)Liquiditätsprämien und deren Integration in die interne Steuerungsarchitektur, Frankfurt: Bankakademie Verlag 2016.
- Stausberg, Thomas* (Risikotragfähigkeitskonzepte, 2012): Institutsspezifische Fundierung von Risikotragfähigkeitskonzepten, in: *Becker, Axel, Schulte-Mattler, Hermann* (Hrsg.): Finanzkrise 2.0 und Risikomanagement von Banken – Regulatorische Entwicklungen – Konzepte für die Umsetzung, Berlin: Erich Schmidt Verlag 2012, S. 413 – 464.
- Steiner, Manfred, Bruns, Christoph, Stöckl, Stefan* (Wertpapiermanagement, 2012): Wertpapiermanagement – Professionelle Wertpapieranalyse und Portfoliostrukturierung, 10. Auflage, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012.
- Steiner, Manfred, Wenninger, Christian, Willinsky, Christian* (Value at Risk, 2002): Value-at-Risk-Schätzung bei Optionen – ein empirischer Vergleich praxisüblicher Verfahren, in: *Financial Markets and Portfolio Management*, 16 (2002), Nr. 1, S. 69 – 87.
- Steinwachs, Patrick* (Messung Zinsänderungsrisiken, 2012): Abbildung und Messung von Zinsänderungsrisiken, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Zinsrisikomanagement, 2. Auflage, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg 2012, S. 89 – 140.
- Stoklossa, Harald* (Zinsstrukturtheorie, 2010): Die Zinsstrukturtheorie – Eine Analyse der Faktoren, Arbitrage und Volatilität für das Euro-Währungsgebiet, Wiesbaden: Gabler Verlag 2010, (zugl. Diss. Universität zu Köln 2010).
- Sturm, Bodo, Vogt, Carsten* (Makroökonomie, 2016): Makroökonomie – Eine anwendungsorientierte Einführung, Stuttgart: Kohlhammer Verlag 2016.
- Thiele, Carl-Ludwig* (Niedrigzinsumfeld, 2017): Wohin geht die Reise? – Die Zukunft des Bankensektors im Niedrigzinsumfeld, Vortrag bei der Handelsblatt Jahrestagung „Privatkundengeschäft“, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017\\_02\\_16\\_thiele.html?view=render%5BDruckversion%5D](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2017/2017_02_16_thiele.html?view=render%5BDruckversion%5D), (Zugriff 2017-04-09, 14:15 MEZ).
- Vayanos, Dimitri* (Flight-to-Quality, 2004): Flight to Quality, Flight to Liquidity, and the Pricing of Risk, <http://www.haas.berkeley.edu/groups/finance/Tvliq2.pdf>, (Zugriff 2017-08-05, 11:32 MEZ).
- Verbeek, Marno* (Econometrics, 2012): A Guide to Modern Econometrics, 4. Auflage, Chichester, West Sussex, Vereinigtes Königreich Großbritannien: John Wiley & Sons 2012.

- Wegner, Olaf, Sievi, Christian R.* (Autokorrelation, 2010): Die Verfahren der Sparkassen bewähren sich in Theorie und Praxis, in: Betriebswirtschaftliche Blätter, 16 (2010), Nr. 07, S. 392 – 397, <http://www.dr-sievi.de/fileadmin/downloads/aufsaeetze/DieVerfahrenDerSparkassenBewahrenSich.pdf>, (Zugriff 2017-03-15, 20:17 MEZ).
- Wehn, Carsten S., von Zanthier, Ulrich* (Copula, 2012): Risikosteuerung im Rahmen der ökonomischen Kapitalsteuerung in: *Bartzky, Peter* (Hrsg.): Praxis der Gesamtbanksteuerung, Methode – Lösungen – Anforderungen der Aufsicht, Stuttgart: Schäffer-Poeschel Verlag 2012, S. 163 – 177.
- Weidmann, Jens* (Niedrigzinsumfeld, 2016): Herausfordernde Zeiten – Perspektiven für den Bankensektor, Festrede bei der Jubiläumsveranstaltung „100 Jahre VÖB“, [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2016/2016\\_11\\_10\\_weidmann.html?view=render%5BDruckversion%5D](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Reden/2016/2016_11_10_weidmann.html?view=render%5BDruckversion%5D), (Zugriff 2017-04-09, 13:47 MEZ).
- Wiedemann, Arnd* (Messung Zinsrisiko I, 2002): Messung von Zinsrisiken mit dem Value-at-Risk-Konzept (1), in: Das Wirtschaftsstudium, 8 (2002), Nr. 11, S. 1416 – 1423, [http://www.ccfb.de/fileadmin/media/gesamtbank/VaR\\_fuer\\_WISU\\_Teil\\_1.pdf](http://www.ccfb.de/fileadmin/media/gesamtbank/VaR_fuer_WISU_Teil_1.pdf), (Zugriff 2017-03-15, 19:53 MEZ).
- Wiedemann, Arnd* (Messung Zinsrisiko II, 2002): Messung von Zinsrisiken mit dem Value-at-Risk-Konzept (2), in: Das Wirtschaftsstudium, 8. Jahrgang 2002, Nr. 12, S. 1548 – 1553, [http://www.ccfb.de/fileadmin/media/gesamtbank/VaR\\_fuer\\_WISU\\_Teil\\_2.pdf](http://www.ccfb.de/fileadmin/media/gesamtbank/VaR_fuer_WISU_Teil_2.pdf), (Zugriff 2017-03-15, 19:53 MEZ).
- Wiedemann, Arnd* (Risikotriade, 2013): Risikotriade – Teil 1 – Messung von Zins-, Kredit- und operationellen Risiken, 3. Auflage, Frankfurt: Frankfurt School Verlag 2013.
- Wiedemann, Arnd, Lüders, Uwe* (Zinsrisikosteuerung, 2006): Zinsrisikosteuerung und aufsichtsrechtliche Entwicklungen, in: *Wiedemann, Arnd, Lüders, Uwe* (Hrsg.): Integrierte Rendite-/Risikosteuerung, 2. Auflage, Münster: Monsenstein und Vannerdat Verlag, S. 177 – 193.
- Wiedemann, Arnd, Lüders, Uwe* (Zinsrisikomessung, 2006): Von den Sensitivitätsverfahren zu statistischen Modellen, in: *Wiedemann, Arnd, Lüders, Uwe* (Hrsg.): Integrierte Rendite-/Risikosteuerung, 2. Auflage, Münster: Monsenstein und Vannerdat Verlag, S. 107 – 141.
- Willemse, Michael* (Zinsbuchsteuerung, 2012): Entwicklung einer Zinsrisikostategie, in: *Reuse, Svend* (Hrsg.): Zinsrisikomanagement, 2. Auflage, Heidelberg: Finanz Colloquium Heidelberg, 2012, S. 143 – 158.
- Winker, Peter* (Ökonometrie, 2007): Empirische Wirtschaftsforschung und Ökonometrie, 2. Auflage, Heidelberg: Springer Verlag 2007.
- Wüst, Kirsten* (Finanzmathematik, 2006): Finanzmathematik – Vom klassischen Sparbuch zum modernen Zinsderivat, Wiesbaden: Gabler Verlag 2006.
- Woolridge, Philip D.* (Benchmark, 2001): The emergence of new benchmark yield curves, 6. (2011), Nr. 12, S. 48 – 57, <http://www.bis.org/publ/rqt0112f.pdf>, (Zugriff 2017-03-10, 17:28 MEZ).
- Ziggel, Daniel, Berens, Tobias* (Expected Shortfall, 2014): Risikomessung mit dem Expected Shortfall, in: Risiko Manager, 9 (2014), Nr. 01, S. 27 – 30.