
Literaturverzeichnis

- Albrecht, P./Maurer, R. (2008): *Investment- und Risikomanagement*, 3. Auflage, Schäffer-Poeschel Verlag, Stuttgart 2008
- Albrecht, P./Schradin, H. R. (1998): Alternativer Risikotransfer: Verbriefung von Versicherungsrisiken, in: *Zeitschrift für die gesamte Versicherungswissenschaft*, 1998, S. 573–610
- Altenähr, Volker/Nguyen, Tristan/Romeike, Frank (2009): *Risikomanagement kompakt*, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe 2009
- BaFin (Hrsg.) (2004a): Rundschreiben 1/2004 (VA) über die Durchführung von Stresstests. Bonn, Frankfurt a. M., vom 17.02.2004
- BaFin (Hrsg.) (2004b): Rundschreiben 7/2004 (VA) Anlagen in Hedgefonds. Bonn, Frankfurt a. M., vom 20.08.2004
- BaFin (Hrsg.) (2005): Rundschreiben 15/2005 (VA) (Anlage des gebundenen Vermögens; Anlagemanagement und interne Kontrollverfahren). Bonn, Frankfurt a. M., vom 20.08.2005
- BaFin (Hrsg.) (2009): Rundschreiben 3/2009 (VA) – Aufsichtsrechtliche Mindestanforderungen an das Risikomanagement. Bonn, Frankfurt a. M., vom 22.01.2009
- BaFin (Hrsg.) (2011): Rundschreiben 4/2011 (VA) – Hinweise zur Anlage des gebundenen Vermögens von Versicherungsunternehmen, Geschäftszeichen VA 54 – I 3200
- Beike, Rolf/Barckow, Andreas (2002): *Risk-Management mit Finanzderivaten. Steuerung von Zins- und Währungsrisiken*, 3. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2002
- Beike, Rolf/Schlütz, Johannes (2010): *Finanznachrichten lesen-verstehen-nutzen. Ein Wegweiser durch Kursnotierungen und Marktberichte*, 5. Auflage, Schäffer-Poeschel Verlag, Stuttgart 2010
- Bieg, H./Kußmaul, H./Waschbusch, G. (2010): *Finanzierung- in Übungen*, 2. Auflage, Vahlen Verlag, München 2010
- Bieg, H./Kußmaul, H./Waschbusch, G. (2009): *Investition in Übungen*, 2. Auflage, Vahlen Verlag, München 2009
- Black, F./Jones, R. (1987): Simplifying Portfolio Insurance, in *Journal of Portfolio Management*, 13 Jg. 1987, S. 48–51
- Bruns, Christoph/Meyer-Bullerdiek, Frieder (2008): *Professionelles Portfoliomanagement. Aufbau, Umsetzung und Erfolgskontrolle strukturierter Anlagestrategien*, 4. Auflage, Schäffer-Poeschel Verlag, Stuttgart 2008
- Cottin, Claudia/Döhler, Sebastian (2009): *Risikoanalyse. Modellierung, Beurteilung und Management von Risiken mit Praxisbeispielen*, Vieweg+Teubner, Wiesbaden 2009
- Daume, P. (2009): *Finanzmathematik im Unterricht*, Vieweg+Teubner, Wiesbaden 2009
- Ermschel, Ulrich, Möbius, Christian, Wengert, Holger (2011): *Investition und Finanzierung*, 2. Auflage, Physica-Verlag, Berlin et al. 2011

- Estep, T./Kritzman, M. (1988): TIPP: Insurance without complexity, in: *Journal of Portfolio Management*, 14 Jg., 1988, S. 38–42
- Eurex (2007a): Aktien- und Aktienindexderivate. Handelsstrategien, Frankfurt a. M., Zürich 2007
- Eurex (2007b): Aktien- und Aktienindexderivate. Handelsstrategien – Fragen und Fallstudien, Frankfurt a. M., Zürich 2007
- Eurex (2007c): Zinsderivate. Fixed Income-Handelsstrategien, Frankfurt a. M., Zürich 2007
- Eurex (2006): Zinsderivate. Fixed Income-Handelsstrategien – Fragen und Fallstudien, Frankfurt a. M., Zürich 2006
- Farny, Dieter (2006): *Versicherungsbetriebslehre*, 4., überarbeitete. Auflage, Verlag Versicherungswirtschaft Karlsruhe 2006
- Franke, Günter/Hax, Herbert (2004): *Finanzwirtschaft des Unternehmens und Kapitalmarkt*, 5. Auflage, Springer-Verlag, Berlin et al. 2004
- Führer, Christian (2010): *Asset Liability Management in der Lebensversicherung*, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe 2010
- GDV (2009): Broschüre: Operationale Risiken unter Solvency II aus Sicht der deutschen Versicherungswirtschaft. Berlin 2009
- Hicks, John R. (1939): *Value and Capital*, Oxford University Press, Oxford 1939
- Hull, John (2001): *Einführung in Futures- und Optionsmärkte*, 3. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2001
- Hull, John C. (2010): *Risikomanagement. Banken, Versicherungen und andere Finanzinstitutionen*, 2. Auflage, Pearson Studium, München 2010
- Hull, John (2012): *Optionen, Futures und andere Derivate*, 8. Auflage, Pearson Studium, München 2012
- Kellermann, Nina (2001): *Risikotransfer bei Versicherungsunternehmen mit Konzepten der Rückversicherung und des Alternativen Risikotransfers*, Cuvillier Verlag, Göttingen 2001
- Koch, Peter/Holthausen, Hubert (2002): *Individualversicherung. Versicherungslehre 1*, Hrsg. Deutsche Versicherungsakademie, 5. Auflage, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe 2002
- Kruschwitz, Lutz (2011): *Investitionsrechnung*, 13. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2011
- Kruschwitz, Lutz (2010): *Finanzmathematik*, 5. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2010
- Kruschwitz, Lutz/Husmann, Sven (2012): *Finanzierung und Investition*, 7. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2012
- Liebwein, Peter (2009): *Klassische und moderne Formen der Rückversicherung*, Verlag Versicherungswirtschaft, 2. Auflage, Karlsruhe 2009
- Lintner, John (1965): The valuation of risky assets and the selection of risky investments in stock portfolios and capital budgets, in: *The Review of Economics and Statistics*, 47 Jg., 1965, S. 13–37
- Macaulay, Frederick R. (1938): *Some Theoretical Problems Suggested by the Movements of Interest Rates, Bond Yields, and Stock Prices in the U.S. since 1856*, National Bureau of Economic Research, New York 1938
- Markowitz, Harry M. (1952): Portfolio Selection, in: *Journal of Finance*, 7. Jg. 1952, S. 77–91
- Mossin, Jan (1966): Equilibrium in a capital asset market, in: *Econometrica*, 34 Jg., 1966, S. 768–783
- Nguyen, Tristan (2007): *Grenzen der Versicherbarkeit von Katastrophenrisiken. Erweiterungsmöglichkeiten durch Rückversicherung, Katastrophenanleihen und Versicherungsderivate*, Gabler Verlag 2007
- Nguyen, Tristan (2008): *Handbuch der wert- und risikoorientierten Steuerung von Versicherungsunternehmen*, Verlag Versicherungswirtschaft 2008
- Perold, A. F. (1986): *Constant Proportion Portfolio Insurance*, Boston 1986

- Perridon, Louis/Steiner, Manfred/Rathgeber, Andreas (2012): Finanzwirtschaft der Unternehmung, 16. Auflage, Verlag Vahlen, München 2012
- Priemeier, Thomas (2005): Finanzrisikomanagement im Unternehmen. Ein Praxishandbuch, Vahlen Verlag, München 2005
- Romeike, Frank (2004): Lexikon Risiko-Management, Wiley-VCH Verlag, Weinheim 2004
- Romeike, Frank/Müller-Reichart, Matthias (2008): Risikomanagement in Versicherungsunternehmen, 2. Auflage, Wiley-VCH Verlag, Weinheim 2008
- Rudolph, Bernd/Schäfer, Klaus (2010): Derivative Finanzinstrumente. Eine anwendungsbezogene Einführung in Märkte, Strategien und Bewertung, 2. Auflage, Springer Verlag, Berlin et al. 2010
- Schäfer, Dorothea/Kruschwitz, Lutz/Schwake, Mike (1995): Studienbuch Finanzierung und Investition, de Gruyter, Berlin et al. 1995
- Schwepecke, Andreas (2004): Rückversicherung, 2. Auflage, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe 2004
- Sharpe, William F. (1964): Capital asset prices: a theory of market equilibrium under conditions of risk, in: The Journal of Finance, 19. Jg., 1964, S. 425–442
- Spremann, Klaus (2008): Portfoliomanagement, 4. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2008
- Spremann, Klaus (2010): Finance, 4. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2010
- Spremann, Klaus/Gantenbein, Pascal (2007): Zinsen, Anleihen, Kredite, 4. Auflage, Oldenbourg Verlag 2007
- Steiner, Manfred/Bruns, Christoph/Stöckl, Stefan (2012): Wertpapiermanagement. Professionelle Wertpapieranalyse und Portfoliostrukturierung, 12. Auflage, Schäffer-Poeschel Verlag, Stuttgart 2012
- Steiner, Peter/Uhlir, Helmut (2001): Wertpapieranalyse, 4. Auflage, Physica-Verlag, Heidelberg 2001
- Stocker, Klaus (2006): Management internationaler Finanz- und Währungsrisiken, 2. Auflage, Gabler Verlag, Wiesbaden 2006
- Tobin, James (1958). Liquidity Preference as Behavior Towards Risk. Review of Economic Studies, 25.1, 1958, S. 65–86
- Trautmann, Siegfried (2007): Investition. Bewertung, Auswahl und Risikomanagement, 2. Auflage, Springer-Verlag, Berlin et al. 2007
- Volkart, Rudolf (2011): Corporate Finance. Grundlagen von Finanzierung und Investition, 5. Auflage, Versus-Verlag, Zürich 2011
- Wagner, Fred (2000): Risk Management im Erstversicherungsunternehmen, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe 2000
- Wiedemann, Arnd (2008): Risikotriade. Zins-, Kredit- und operationelle Risiken, 2. Auflage, Frankfurt School Verlag, Frankfurt/Main 2008
- Wiedemann, Arnd (2009): Financial Engineering. Bewertung von Finanzinstrumenten, 5. Auflage, Frankfurt School Verlag, Frankfurt/Main 2009
- Wieggers, Anton (2001): Ansätze zur Risikosteuerung bei Kapitalmarktrisiken von Lebensversicherungsunternehmen, in: Schwebler/Knauth/Simmert (Hrsg.), Kapitalmärkte: Aktuelle Anlage- und Absicherungsmöglichkeiten für Versicherungsunternehmen, S. 337–361, Karlsruhe 2001
- Winter, R. von (2001): Risikomanagement und Interne Kontrollen beim Sachversicherer im Sinne des KonTraG, Verlag Versicherungswirtschaft, Karlsruhe. 2001
- Wolf, K./Runzheimer, B. (2003): Risikomanagement und KonTraG, Konzeption und Implementierung, 4. Auflage, Gabler Verlag, Wiesbaden 2003
- Wolke, Thomas (2008): Risikomanagement, 2. Auflage, Oldenbourg Verlag, München 2008

Internetquellen

- Allianz: Unternehmensnachricht auf allianz.com vom 10.04.2007 https://www.allianz.com/de/presse/news/finanznews/allianz_aktie_und_anleihen/news_2007-04-10.html
- Allianz: Unternehmensnachricht auf allianz.com vom 27.11.2007 https://www.allianz.com/de/presse/news/finanznews/allianz_aktie_und_anleihen/news_2007-11-12.html
- Allianz: Unternehmensnachricht auf allianz.com vom 20.04.2009 https://www.allianz.com/de/presse/news/geschaeftsfelder_news/versichern/news_2009-04-20.html
- Allianz: Unternehmensnachricht auf allianz.com vom 27.05.2009 https://www.allianz.com/de/presse/news/geschaeftsfelder_news/versichern/news_2010-05-27.html
- Anlageverordnung: http://www.bafin.de/cln_179/nn_721188/SharedDocs/Aufsichtsrecht/DE/Verordnungen/anlv.html?_nnn=true
- Deckungsrückstellungsverordnung: http://www.bafin.de/cln_179/nn_721188/SharedDocs/Aufsichtsrecht/DE/Verordnungen/deckrv.html?_nnn=true
- D. Diers, H.-J. Zwiesler: Interne Unternehmensmodelle, http://www.ifaulm.de/downloads/Interne_Modelle.pdf
- <http://www.tristan-nguyen.de/pdf/A21.pdf>
- <http://www.ceiops.eu/media/files/publications/submissionstotheec/CEIOPS-Calibration-paper-Solvency-II.pdf>
- Kapitalausstattungsverordnung http://www.bafin.de/cln_179/nn_721188/SharedDocs/Aufsichtsrecht/DE/Verordnungen/kapausstv_ab_100101.html?_nnn=true
- Kalkulationsverordnung http://www.bafin.de/cln_179/nn_721188/SharedDocs/Aufsichtsrecht/DE/Verordnungen/kalv_ab_090101.html?_nnn=true
- Rechnungslegungsverordnung http://www.bafin.de/cln_179/nn_721188/SharedDocs/Aufsichtsrecht/DE/Verordnungen/rechversv.html?_nnn=true
- www.eurexchange.com/trading/products/INT/FIX/FGBL_de.html?mode=deliverable_bonds
(Abrufungsdatum 18.02.2010)
- www.bafin.de: