

Inhaltsübersicht

Geleitwort	VII
Vorwort	IX
Inhaltsübersicht	XI
Inhaltsverzeichnis	XV
Abbildungsverzeichnis	XXI
Tabellenverzeichnis	XXV
Abkürzungsverzeichnis	XXVII
Symbolverzeichnis	XXXI
1 Sicherheit hat ihren Preis	1
1.1 Problemstellung	1
1.2 Zielsetzung	2
1.3 Vorgehensweise	4
2 Liquidität als Bankenbasisrisiko	7
2.1 Risiko-/Chancenallokation als originäres Bankgeschäft	7
2.2 Institutsspezifische Liquiditätsrisikokomponenten	14
2.3 Marktspezifische Liquiditätsrisikokomponenten	16
2.4 Folgerisiken	21
2.5 Zwischenfazit	29
3 Rahmenbedingungen	33
3.1 Aufsichtsrechtliche Managementstrategien	33
3.2 Institutsspezifische Managementstrategien	46
3.3 Zwischenfazit	73
4 Transferpreise für Liquiditätsrisiken	77

4.1	Implementierung eines Transferpreissystems	77
4.2	Transferpreise für strukturelle Liquidität	81
4.3	Transferpreis der Liquiditätsbevorratung	103
4.4	Zwischenfazit	116
5	Dimensionen des Liquiditätspuffers	119
5.1	Höhe	120
5.2	Komponenten	127
5.3	Beleihungs-/Liquidierungswert	148
5.4	Liquidierungsgeschwindigkeit	152
5.5	Kumulierte Liquiditätspufferkosten	154
5.6	Exkurs: Backtesting und Gesamtbanksteuerung	162
5.7	Zwischenfazit	168
6	Dimensionen der Liquiditätsreserve	171
6.1	Höhe	172
6.2	Komponenten	174
6.3	Beleihungs-/Liquidierungswert	182
6.4	Liquidierungsgeschwindigkeit	185
6.5	Kumulierte Liquiditätsreservekosten	186
6.6	Exkurs: Backtestfähigkeit und Gesamtbanksteuerung	194
6.7	Zwischenfazit	194
7	Optimierung der Liquiditätsbevorratung	197
7.1	Zusammenführung der Liquiditätsbevorratungskosten	198
7.2	Berücksichtigung des Portfolioaspektes im Optimierungsmodell	209
7.3	Optimierungsansätze	216
7.4	Zwischenfazit	246

	XIII
8 Transferpreise für Liquiditätsbevorratungskosten	247
8.1 Institutsinterner Risikotransfer	248
8.2 Institutsübergreifender Risikotransfer	253
8.3 Zwischenfazit	262
9 Fazit und Ausblick	263
Literaturverzeichnis	269
Anhang	285