

Inhaltsverzeichnis

Vorwort der Herausgeber	5
Bearbeiterverzeichnis	9
Abkürzungsverzeichnis	11
Einführung	17
1 Allgemeine Bestimmungen	31
2 Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten	51
3 Eigenmittelanforderungen	79
3.1 Kreditrisiko – Standardansatz (KSA)	81
3.2 Kreditrisiko – Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)	101
3.3 Kreditrisikominderung	115
3.4 Verbriefungen	131
3.5 Gegenparteiausfallrisiko	147
3.6 Eigenmittelanforderungen für das Operationelle Risiko	167
3.7 Eigenmittelanforderungen für das Marktrisiko	173
3.8 Eigenmittelanforderungen für das Abwicklungsrisiko	187
3.9 CVA-Risiko	191
4 Großkredite	201
5 Liquidität	217
6 Verschuldung	299
7 Offenlegung	311

Anhänge	341
Anhang 1: Grundlegende Begriffsbestimmungen nach Art. 4 CRR	343
Anhang 2: Inhaltsverzeichnis der Capital Requirements Regulation (CRR)	363
Anhang 3: Übersicht über die von der EBA oder ESMA zu veröffentlichenden Standards und Leitlinien im Rahmen der CRR bzw. CRR II	371
Anhang 4: Ausblick	407
Anhang 5: Bestandsregelungen	409
Anhang 5a: Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (Kap. 2)	411
Anhang 5b: Kreditrisiko – Standardansatz (KSA) (Kap. 3.1)	417
Anhang 5c: Gegenparteiausfallrisiko (Kap. 3.5)	421
Anhang 5d: CVA-Risiko (Kap. 3.9)	435
Anhang 5e: Liquidität (Kap. 5)	437
Anhang 5f: Verschuldung (Kap. 6)	491