

1 Einleitung: Warum?	1
2 Kreditrisiko	3
2.1 Default Mode-Modelle	3
2.2 Migration Mode-Modelle	5
3 Credit Spread-Risiken	11
3.1 Notwendigkeit zur Berücksichtigung von Credit Spread-Risiken	11
3.2 Korrelationen und Diversifikationseffekte	13
3.3 Quantifizieren von Credit Spread-Risiken	16
3.4 Gemeinsame Betrachtung von Zinsänderungs- und Credit Spread-Risiken	20
4 Die „Anderen“	23
4.1 Liquiditätsrisiken	23
4.2 Länderrisiken	24
5 Fazit	25
Was Sie aus diesem Essential mitnehmen können	27
Literaturverzeichnis / „Zum Weiterlesen“	29