

Inhaltsverzeichnis

Vorwort des DIIR	5
Vorwort der Arbeitsgruppe	7
Abbildungsverzeichnis	11
Abkürzungsverzeichnis	13
1 Einleitung	15
2 Risikotragfähigkeitskonzept	17
2.1 Methoden und Annahmen zur Ermittlung der Risikotragfähigkeit	21
2.2 Plausibilisierung und Qualitätssicherung des zu Grunde liegenden Modells	25
2.3 Ökonomische Bewertung	27
2.4 Berechnung der anrechenbaren Eigenmittel zur Risikodeckung	31
2.5 Berechnung des individuellen Gesamtrisikos	36
2.6 Gegenüberstellung von Risikodeckungspotenzial und Gesamtrisiko	58
2.7 Rückkopplung mit der Geschäftsstrategie	61
3 Limitierung	63
3.1 Risikokapitalbasierte Limitierung und Kennzahlensystem ..	63
3.2 Überwachung des Limitsystems und Berichtswesen	67
3.3 Konsistenz zwischen Limitierung und Risikostrategie	69
4 Ausblick	73
Glossar	75
Literaturverzeichnis	81
Anhang	83