

# Inhaltsverzeichnis

Vorwort des DIIR .....	5
Vorwort der Arbeitsgruppe .....	7
Abbildungsverzeichnis .....	11
Abkürzungsverzeichnis .....	13
<b>1 Einleitung .....</b>	<b>15</b>
<b>2 Risikotragfähigkeitskonzept .....</b>	<b>17</b>
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
<b>3 Limitierung .....</b>	<b>63</b>
3.1 Risikokapitalbasierte Limitierung und Kennzahlensystem .....	63
3.2 Überwachung des Limitsystems und Berichtswesen .....	67
3.3 Konsistenz zwischen Limitierung und Risikostrategie .....	69
<b>4 Ausblick .....</b>	<b>73</b>
Glossar .....	75
Literaturverzeichnis .....	81
Anhang .....	83