

Inhaltsübersicht

	Seite
A Einleitung	1
B Bestandsaufnahme im Schrifttum zur Liquiditätssteuerung im Bankbetrieb.....	11
C Begriffliche und inhaltliche Abgrenzung der Steuerung des Grundsatzes II.....	63
D Finanzwirtschaftliche Analyse des Regelwerkes des Grundsatzes II	75
E Methoden zur Risikoschätzung für die Steuerung des Grundsatzes II	86
F Zusammenfassung und Ausblick	247

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Inhaltsübersicht.....	IX
Inhaltsverzeichnis	X
Abbildungsverzeichnis.....	XIII
Tabellenverzeichnis	XVII
Abkürzungsverzeichnis.....	XIX
Verzeichnis häufig verwendeter Symbole.....	XXIV
A Einleitung	1
I Problemstellung	1
II Ziel, Methodik und Aufbau der Arbeit	5
B Bestandsaufnahme im Schrifttum zur Liquiditätssteuerung im Bankbetrieb	11
I Systematisierung des betriebswirtschaftlichen Liquiditätsbegriffs	11
1 Mehrdimensionalität des betriebswirtschaftlichen Liquiditätsbegriffs	12
1.1 Pagatorische Dimension des betriebswirtschaftlichen Liquiditätsbegriffs	14
a) Liquidität von Wirtschaftssubjekten	15
b) Liquidität von Wirtschaftsobjekten.....	20
1.2 Materielle Dimension des betriebswirtschaftlichen Liquiditätsbegriffs	23
1.3 Informatorische Dimension des betriebswirtschaftlichen Liquiditätsbegriffs	29
2 Besondere Merkmale der bankbetrieblichen Liquidität	32
II Komponenten des finanziellen Gleichgewichts im Bankbetrieb	38
III Risikokalküle im Konzept einer ertragsorientierten Banksteuerung	45
IV Ursachenbezogene Analyse bankbetrieblicher Liquiditätsrisiken	49
V Wirkungsbezogene Analyse bankbetrieblicher Liquiditätsrisiken	54
VI Einordnung der Arbeit in das Schrifttum	59

C	Begriffliche und inhaltliche Abgrenzung der Steuerung des Grundsatzes II	63
I	Formale Begriffsinhalte der bankbetrieblichen Liquiditätssteuerung.....	63
II	Funktionale Begriffsinhalte der bankbetrieblichen Liquiditätssteuerung.....	69
III	Begriff der Steuerung des Grundsatzes II.....	74
D	Finanzwirtschaftliche Analyse des Regelwerkes des Grundsatzes II	75
I	Liquiditätsabbildung im Regelwerk des Grundsatzes II.....	75
II	Analyse der Liquiditätsabbildung im Regelwerk des Grundsatzes II.....	81
III	Zusammenfassendes Zwischenergebnis.....	85
E	Methoden zur Risikoschätzung für die Steuerung des Grundsatzes II	86
I	Definitiorische Grundlagen.....	86
1	Begriff des Saldos autonomer Zahlungen.....	86
2	Begriff des Liquidity at Risk.....	90
II	Ansätze zur Ermittlung des Liquidity at Risk.....	96
1	Nichtparametrischer Ansatz zur Ermittlung des Liquidity at Risk.....	96
2	Parametrischer Ansatz zur Ermittlung des Liquidity at Risk.....	102
3	Semiparametrischer Ansatz zur Ermittlung des Liquidity at Risk.....	107
III	Schätzung des Risikos autonomer Zahlungen mit der POT-Methode.....	114
1	Grundlagen der POT-Methode.....	115
1.1	Verallgemeinerte Extremwertverteilung und verallgemeinerte Paretoverteilung.....	115
1.2	Risikoschätzung mit der POT-Methode.....	121
2	Ermittlung von Stressszenarien für autonome Zahlungen mit der POT-Methode.....	128
2.1	Begriff des Stressszenarios autonomer Zahlungen.....	128
2.2	Erhebung des Saldos autonomer Zahlungen.....	132
2.3	Prüfung des Saldos autonomer Zahlungen auf Zufälligkeit.....	137

2.4	Ermittlung von GPD-Approximationen des Saldos autonomer Zahlungen.....	144
	a) Schätzung der GPD-Schwellen mit dem Sample Mean Excess Plot	146
	b) Schätzung der GPD-Parameter mit der ML-Methode	149
	c) Schätzung der GPD-Parameter mit der PWM-Methode.....	153
	d) Schätzung der GPD-Parameter mit dem Sample Mean Excess Plot	157
	e) Schätzung der GPD-Parameter mit dem QQ-Plot	162
2.5	Überprüfung der Verteilungsannahmen für die Risikoschätzung.....	170
	a) Statistische Überprüfung der GPD-Approximationen.....	171
	b) Deskriptive Untersuchung der Approximationsgüte	179
2.6	Berechnung von Stressszenarien für den Saldo autonomer Zahlungen.....	186
2.7	Ergebnisübersicht zu den Stressszenarien für autonome Zahlungen..	191
3	Empirische Überprüfung der Stressszenarien für autonome Zahlungen.....	194
IV	Anwendungsperspektive des Liquidity at Risk in der Gelddisposition	205
1	Einordnung des Liquidity at Risk in die Gelddisposition	206
2	Analyse des Liquiditätsrisikos in der Gelddisposition	210
3	Beurteilung und Steuerung des Liquiditätsrisikos in der Gelddisposition.....	220
4	Kontrolle des Liquiditätsrisikos in der Gelddisposition.....	226
V	Zusammenfassendes Zwischenergebnis.....	236
F	Zusammenfassung und Ausblick	247
	Anhang: Zeitreihe des Saldos autonomer Zahlungen einer Regionalbank.....	XXVII
	Literaturverzeichnis	XXXIII