

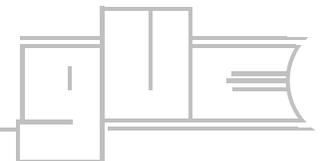
Gesellschaft für Unternehmensrechnung und Controlling m.b.H.

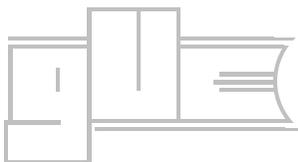
- *wissenschaftlicher Verlag*
- *Beratung*
- *Schulung*

Sie planen eine Veröffentlichung (z.B. Lehrbuch, Fach-/Sachbuch, Dissertation, Habilitation) mit:

- **ISBN** (Internationale Standard-Buchnummer zur weltweit eindeutigen Identifikation),
- **VLB**-Eintrag ['Verzeichnis Lieferbarer Bücher' - die Datenbank im Internet zur Auswahl und Recherche im größten deutschsprachigen Titelangbot] und **CIP**-Aufnahme,
- **VG WORT**-Mitgliedschaft (zur Realisierung Ihrer Autoren-Tantieme) und
- **GUC**-Präsentation von Detail- und Verkaufsinformationen auf unserer Web-Site sowie
- **Anmeldung** bei Online-Buchhandlungen, z.B. amazon.de, buchhandel.de, lob.de.

Dann setzen Sie sich bitte mit uns in
Verbindung: **www.guc-verlag.de**



**GUC - Gesellschaft für
Unternehmensrechnung
und Controlling m. B. H.**09130 Chemnitz
Uhlandstr. 11**Tel.:** 0371 / 5380886**Mobil:** 0160 96724525**GUC @ GUC - online. de**<http://www.guc-verlag.de>

Verkehrsnummer: 97 250

Stefan Zeranski

„Liquidity at Risk zur Steuerung des liquiditätsmäßig-finanziellen Bereichs von Kreditinstituten“

(Dissertation)

bestellbar beim Verlag der GUC:

- per FAX: 0371/53 80 886,
- Internetformular: www.guc-online.de,
- per E-Mail: guc@guc-online.de oder
- per Post:
GUC m.B.H.
Uhlandstr. 11
09130 Chemnitz

Stefan Zeranski:

„Liquidity at Risk zur Steuerung des liquiditätsmäßig-finanziellen Bereichs von Kreditinstituten“

*1. Aufl. 2005, 306 Seiten, kartoniert und kaschiert,
ISBN: 3-934235-35-2*

Inhalt: Basel II und die MaRisk fordern von Banken, dass sie ihr Liquiditätsrisiko anhand ihrer Mittelzuflüsse und Mittelabflüsse quantifizieren. Bislang fehlten für Banken geeignete Konzepte analog zum Value at Risk, die empirisch gestützt Liquiditätsbelastungen schätzen, um damit eine Liquiditätsreserve für eine Liquiditätsanforderung bestimmen zu können, die in einem bestimmten Zeitraum mit einer bestimmten Wahrscheinlichkeit nicht überschritten wird.

In der vorliegenden Arbeit werden das bankbetriebliche Liquiditätsrisiko anhand der Zahlungsströme einer Bank erforscht und autonome Auszahlungsüberschüsse auf geschäftstäglicher Basis mit Hilfe der Extremwertstatistik geschätzt. Die empirische Analyse beinhaltet Liquiditätsabflüsse aus einem Bankrun und zeigt, dass der in einem normalen Geschäftsbetrieb ermittelte Liquidity at Risk auch zur Vorhersage des Liquiditätsrisikos in Extremsituationen einsetzbar ist. Das vorgestellte Konzept des Liquidity at Risk ermöglicht bei umsichtiger Anwendung nachhaltige Erträge aus der Fristentransformation im normalen Geschäftsbetrieb und liefert einen Beitrag zur Erfüllung bankaufsichtlicher Anforderungen aus Basel II.

Die vorliegende Dissertation wurde mit dem Sonderforschungspreis 2004 der Commerzbank AG ausgezeichnet.

Zum Autor:

seit 2004 Leiter Treasury der Kölner Bank eG, zuvor Leiter Aktiv-Passiv-Management der SchmidtBank. Nach dem BWL-Studium Traineeprogramm bei der Deutsche Bank AG im Bereich Firmen/Institutionen und danach beim Genossenschaftsverband Sachsen e.V. Schwerpunkte MaH, 6. KWG-Novelle.

Bestellung von ___ Exemplar(en) des Buches (Stefan Zeranski): „Liquidity at Risk zur
Steuerung des liquiditätsmäßig-finanziellen Bereichs von Kreditinstituten“

(ISBN 3-934235-35-2) zum Stückpreis von **49,95 EUR** (incl. 7% USt und Versand).

- Vorkasse: Sparkasse Chemnitz, BLZ: 870 500 00, Kt.-Nr.: 355 200 36 99
- Eurocheck (liegt bei)
- Rechnung

Lieferadresse: Name, Vorname bzw. Institution

Straße, Hausnummer

PLZ, Ort

Datum, Unterschrift:

