

Prof. Dr. Mario Straßberger  
Professur für Betriebswirtschaftslehre,  
insbes. Finanzwirtschaft und Finanzdienstleistungen  
Hochschule Zittau/Görlitz

## Verzeichnis wissenschaftlicher Veröffentlichungen

### Monografien und Herausgeberschaften

*Modern Finance and Risk Management*, World Scientific, New Jersey et al. 2022 [hrsg. zusammen mit T. Klein, S. Loßagk und T. Walther].

*Risikokapitalallokation und Marktpreisrisikosteuerung mit Value-at-Risk-Limiten*, Eul, Lohmar Köln 2002 [zugl. Diss., Technische Universität Dresden].

### Beiträge in Zeitschriften (mit doppelt blindem Begutachtungsverfahren)

*Graph-based representations of credit portfolios and their analysis*, in: European Journal of Economics and Management Sciences **7** (1), 2021, 23–28.

*The institutional developments of the European banking supervision*, in: European Journal of Economics and Management Sciences **1** (3), 2015, 42–46 [zusammen mit L. Sysoyeva].

*Yield Spreads, Value of Bonds, and Implications for Liquidity Management – An Empirical Analysis during the Crisis*, in: Investment Management and Financial Innovations **9** (2), 2012, 146–154.

*Risk Limit Systems and Capital Allocation in Financial Institutions*, in: Banks and Bank Systems **1** (4), 2006, 22–37.

*Capital Requirement, Portfolio Risk Insurance, and Dynamic Risk Budgeting*, in: Investment Management and Financial Innovations **3** (1), 2006, 78–88.

*Zur Allokation von Risikokapital in Handelsdivisionen von Finanzinstituten*, in: Betriebswirtschaftliche Forschung und Praxis **58** (4), 2006, 408–426.

*Standards für das Asset- und Risikomanagement*, in: Finanz Betrieb — Zeitschrift für Unternehmensfinanzierung und Finanzmanagement **5** (10), 2003, 648–651 [zusammen mit H. Locarek-Junge].

*The Estimation of Market Risk in Portfolios of Stocks and Stock Options*, in: sbr — Schmalenbach Business Review **54** (Special Issue 1-02), 2002, 171–189 [zusammen mit H. Locarek-Junge und R. Prinzler].

### **Beiträge in Zeitschriften (teilweise mit Begutachtungsverfahren)**

*Projekt- und Kreditnehmer-Netzwerke*, in: WISU — Das Wirtschaftsstudium **50** (10), 2021, 1041–1045.

*Eine Unternehmensanalyse der Wirecard AG. Geschäftsmodell und mögliche Ansatzpunkte einer Bilanzfälschung*, in: WiSt — Wirtschaftswissenschaftliches Studium **50** (6), 2021, 12–17.

*Risikomodellierung mittels Graphentheorie. Kreditportfoliomodelle für vernetzte Schuldner*, in: Die Bank — Zeitschrift für Bankpolitik und Praxis **61** (4), 2021, 14–17.

*Nicht alle Reformen der Aufsicht geben dem Finanzsystem Halt*, in: Bankmagazin **65** (11), 2016, 32–34 [zusammen mit L. Sysoyeva].

*Mangelnde Transparenz, hohe Risiken*, in: Die Bank — Zeitschrift für Bankpolitik und Praxis **56** (8), 2016, 22–24 [zusammen mit G. Feigin].

*Die aktuellen Entwicklungen der Bankenaufsicht im Lichte der Stabilität des Finanzsystems*, in: Wirtschaftsdienst — Zeitschrift für Wirtschaftspolitik **96** (7), 2016, 486–491 [zusammen mit L. Sysoyeva].

*Fundamente der modernen Finanzierungstheorie*, in: OIKOS — Wissenschaftszeitschrift (1), 2015, 94–96.

*Anlageverhalten tschechischer Sparer*, in: Die Bank — Zeitschrift für Bankpolitik und Praxis **52** (6), 2012, 22–23 [zusammen mit R. Giese und M. Srutek].

*Extremwerttheorie und Modellierung extremer Ereignisse in Finanzzeitreihen*, in: WISU — Das Wirtschaftsstudium **35** (2), 2006, 206–121.

*Ein informationsökonomischer Ansatz zur Erklärung der Existenz von Finanzintermediären*, in: WiSt — Wirtschaftswissenschaftliches Studium **34** (9), 2005, 526–528.

*Modelle zur Schätzung des Value-at-Risk*, in: WISU — Das Wirtschaftsstudium **34** (1), 2005, 73–78.

*Aufbau und Grundlagen von Marktrisikomodellen*, in: WISU — Das Wirtschaftsstudium **33** (6), 2004, 765–770.

*Risikomessung, Risikomaße und Value-at-Risk*, in: WISU — Das Wirtschaftsstudium **33** (2), 2004, 202–207 [zusammen mit W. Kürsten].

*Globaler Eigenhandel von Banken*, in: WiSt — Wirtschaftswissenschaftliches Studium **29** (7), 2000, 397–400.

### **Beiträge in Sammelwerken und Tagungsbänden (teilweise mit Begutachtungsverfahren)**

*Cryptocurrencies as an Asset Class – Holding Bitcoin in German Equities Portfolios*, in: Klein, T. et al. (Hrsg.): Modern Finance and Risk Management, New Jersey et al. 2022, 453–474.

*Bond Yield Spreads During the Financial Crisis – Implications for Liquidity Risk Management*, in: Maksimtsev, I. A. et al. (Hrsg.): Sustainability of National Financial Systems: Searching for New Approaches, St. Petersburg 2012, 159–163.

*Continuous Market Risk Budgeting in Financial Institutions*, in: Weihs, C.; Gaul, W. (Hrsg.): Classification - the Ubiquitous Challenge, Heidelberg 2005, 466–473.

*Risikoklassenkonzept für das Investmentsparen*, in: Achleitner, A.-K.; Everling, O. (Hrsg.): Fondsrating, Wiesbaden 2003, 81–94 [zusammen mit H. Locarek-Junge].

*Verfahren zur Risikokapitalallokation im Eigenhandel von Banken*, in: Leopold-Wildburger, U. et al. (Hrsg.): Operations Research Proceedings 2002, Berlin et al. 2003, 341–346.

*Wann beginnt die Krise? — Ein Blick auf Finanzmarktrenditen*, in: Blum, U. et al. (Hrsg.): Krisenkommunikation, Wiesbaden 2003, 141–152 [zusammen mit H. Locarek-Junge und N. F. Wagner].

*Krisenkommunikation am Kapitalmarkt: Investor Relations in der Unternehmenskrise*, in: Blum, U. et al. (Hrsg.): Krisenkommunikation, Wiesbaden 2003, 125–139 [zusammen mit H. Locarek-Junge und N. F. Wagner].

*Marktpreisrisikoschätzung in Portefeuilles mit nichtlinearen Verlustfunktionen*, in: Buhl, H. U. et al. (Hrsg.): e-Finance. Innovative Problemlösungen für Informationssysteme in der Finanzwirtschaft, Berlin et al. 2001, 295–314 [zusammen mit H. Locarek-Junge und R. Prinzler].

*Schätzung des Marktrisikos von Portefeuilles aus Aktien und Aktienoptionen*, in: Fleischmann, B. et al. (Hrsg.): Operations Research Proceedings 2000, Berlin et al. 2001, 180–187 [zusammen mit H. Locarek-Junge und R. Prinzler].

*Dynamische Limitsetzung*, in: Rudolph, B.; Johanning, L. (Hrsg.): Handbuch Risikomanagement, Bd. 2, Risikomanagement in Banken, Asset-Management-Gesellschaften, Versicherungs- und Industrieunternehmen, Bad Soden 2000, 833–849 [zusammen mit H. Locarek-Junge und H. Vollbehr].

*Direktbanken als Teil des Direct Banking*, in: Locarek-Junge, H.; Walter, B. (Hrsg.): Banken im Wandel: Direktbanken und Direct Banking, Berlin 2000, 25–42 [zusammen mit H. Locarek-Junge und T. Fuchs].

*Die Ermittlung von Value-at-Risk-Handelslimiten zur Kontrolle und Steuerung von Marktrisiken bei kontinuierlicher Überprüfung*, in: Inderfurth, K.

et al. (Hrsg.): Operations Research Proceedings 1999, Berlin et al. 2000, 317–322 [zusammen mit H. Locarek-Junge und H. Vollbeh].

## Rezensionen

*Henking, A.; Bluhm, C.; Fahrmeir, L.: Kreditrisikomessung. Statistische Grundlagen, Methoden und Modellierung, Springer-Verlag Berlin Heidelberg 2006, 312 S., in: OR News (33), 2008, 68-69.*

*Holler, M. J.; Illing, G.: Einführung in die Spieltheorie, Springer-Verlag Berlin Heidelberg 2003, 424 S., in: OR News (22), 2004, 31.*

## Diskussionspapiere

*Bitcoin in German Equities Portfolios: Diversification Benefits and Hedging Abilities, SSRN Working Paper 4800902, 2022.*

*Graph-based Representations of Credit Portfolios and Their Analysis, SSRN Working Paper 3769570, 2018.*

*Die aktuellen Entwicklungen der Bankenaufsicht im Lichte der Stabilität des Finanzsystems, SSRN Working Paper 2797848, 2016 [zusammen mit L. Sysoyeva].*

*Der Bankensektor Russlands im Kontext des WTO-Beitritts: Entwicklungstendenzen und Perspektiven, SSRN Working Paper 2797450, 2015 [zusammen mit G. Feigin].*

*Thoughts on Foundations of the Modern Theory of Finance, SSRN Working Paper 2648520, 2015.*

*The Institutional Developments of the European Banking Supervision, SSRN Working Paper 2648335, 2015 [zusammen mit L. Sysoyeva].*

*Yield Spreads and Bond Values During the Crisis - An Empirical Analysis, SSRN Working Paper 2027961, 2011.*

*Risikokapitalallokation mit Value-at-Risk-Limiten im Handelsbereich einer Bank*, Dresdner Beiträge zur Betriebswirtschaftslehre, Nr. 68/02.

*Asset Management-Standards und Risikomanagement-Standards in Kapitalanlagegesellschaften*, Dresdner Beiträge zur Betriebswirtschaftslehre, Nr. 67/02 [zusammen mit H. Locarek-Junge].

*Die Messung des Marktrisikos von Portefeuilles aus Aktien und Aktienoptionen*, Dresdner Beiträge zur Betriebswirtschaftslehre, Nr. 57/01 [zusammen mit H. Locarek-Junge und R. Prinzler].

*Ergebnisermittlung im globalen Eigenhandel der Banken*, Dresdner Beiträge zur Betriebswirtschaftslehre, Nr. 34/99.

*Bewertung von Absicherungsgeschäften mit Derivaten in Deutschland*, Dresdner Beiträge zur Betriebswirtschaftslehre, Nr. 11/98 [zusammen mit F. Riddermann].

### **Sonstige Beiträge**

*Was sind eigentlich Schulden?*, in: Frankfurter Allgemeine Zeitung, Nr. 297 vom 21. Dezember 2011, 31.