

## 1 Publications

1. Huschens, S. and G. Stahl (1993) Nichtparametrische Maximum-Likelihood-Inferenz mit A-priori-Restriktionen. *Operations Research Proceedings* 1992, 374 – 381
2. Huschens, S. and G. Stahl (1995) Estimation in semiparametric models using an auxiliary model. *Statistical Papers*, **36**, 313 – 326
3. Stahl, G. (1996) Backtesting or Backestimating? *Proceedings of the European SAS User Conference*, 1996
4. Stahl, G. (1997) Three Cheers *Risk Magazine*, May, 67 – 69
5. Article [4] is reprinted in: *Hedging with Trees*, Risk Books, ed. by M. Broadie and P. Glasserman, RISK Publications, London, 251 – 254
6. Stahl, G. (1997) Backtesting using a generalisation of the traffic light approach *Neural Network World* **7**, 565 – 578
7. Davé, R. and G. Stahl (1998) On the Accuracy of VaR-Models. In: *Risk Measurement, Econometrics and Neural Networks*, 189 – 232. Eds.: G. Bol, G. Nakhaeizadeh und K. H. Vollmer, Physika Verlag, Heidelberg
8. Overbeck, L. und G. Stahl (1998) Stochastische Methoden im Risikomanagement von Kreditportfolios. In: *Credit Risk und Value-at-risk Alternativen*, 77 – 110. Hrsg.: A. Oehler, Schäffer-Poeschel, Stuttgart
9. Härdle, W. und G. Stahl (2000) Backtesting beyond VaR. In: *Measuring Risk in Complex Stochastic Systems*. Lecture Notes in Statistics **147**, 119 – 130. Eds.: by Franke, U., W. Härdle and G. Stahl, Springer New York
10. Stahl, G. und U. Traber (2000) Backtesting in Action. In: *Kreditrisikomanagement*, pp. 85 – 106. Ed. A. Oehler, Schäffer-Poeschl, Stuttgart, 2000
11. Dietz, T., G. Stahl und U. Traber (2002) Backtesting in Action. In: *Kreditrisikomanagement*, 219–242. Ed. A. Oehler, Schäffer-Poeschl, Stuttgart, 2nd Ed., 2002, updated version of [9].
12. Stahl, G. und U. Traber (2000) Backtesting Revisited. *Learning Curve, Derivates Week*, London
13. Ridder, T. und G. Stahl (2000) Flexibles oder starres Cash-Flow Mapping? *Handbuch Risikomanagement*, 269 – 288. Hrsg.: L. Johanning und B. Rudolph, Uhlenbruch Verlag, Bad Soden
14. Overbeck, L. und G. Stahl (2000) Backtesting: Allgemeine Theorie, Praxis und Perspektiven. *Handbuch Risikomanagement*, 289 – –320. Hrsg.: L. Johanning und B. Rudolph, Uhlenbruch Verlag, Bad Soden
15. Locarek-Junge, H. und G. Stahl (2001) Value-at-Risk. *Handwörterbuch des Bank- und Finanzwesens*, 2119 – 2128. Hrsg.: W. Gerke u. M. Steiner, Schäffer-Poeschel, Stuttgart

16. Gaumert, U. und G. Stahl (2001) Interne Modelle. *Handwörterbuch des Bank- und Finanzwesens*, 1086 – 1096. Hrsg.: W. Gerke u. M. Steiner, Schäffer-Poeschel, Stuttgart
17. Haferkorn, P. und G. Stahl (2001) Beurteilung von Wahrscheinlichkeitssprognosen durch explorative Diagnoseverfahren. *Proceedings Volume der 5. Konferenz der SAS-Anwender in Forschung und Entwicklung*, 131 – 142. Hrsg.: E. Schumacher, K. Steichfuss Universität Hohenheim, 2001.
18. Bühler, W., Engel T., O. Korn and G. Stahl (2002) Backtesting von Kreditrisikomodellen. In: *Kreditrisikomanagement*, 181 – 218. Ed. A. Oehler, Schäffer-Poeschl, Stuttgart, 2nd Ed., 2002
19. Dietz, T. and G. Stahl (2003) Struktur und Nutzen der MaH. In: *Handel mit Energiederivaten*, 97 – 114. Hrsg.: I. Zenke und N. Ellwanger, C. H. Beck, Munich, 2003
20. Locarek-Junge, H. and G. Stahl (2003) Die Struktur der Mindestanforderungen des Kreditgeschäftes aus prozessorientierter Sicht. In: *Finanzwirtschaft, Kapitalmarkt und Banken*, 429 – 442. Hrsg.: M. Steiner, A. Rathgeber, H.-J. Tebroke und M. Wellmeier, Schäfer-Poeschl Verlag, Stuttgart, 2003
21. Overbeck, L. and G. Stahl (2003) Stochastic Essentials for the Risk Management of Credit Portfolios. *Kredit und Kapital* 2003, (1), 1 – 30.
22. Platen, E. and G. Stahl (2003) A Structure for General and Specific Market Risk. *Computational Statistics*, 2003, (18), 355 – 373
23. Eberlein, E. and G. Stahl (2003) Both sides of the fence: a statistical and regulatory view on electricity risk. *Energy Power Risk Management*, September 2003, 34 – 38
24. Huschens, S. and G. Stahl (2005) A General Framework for IRBA Backtesting. *Zeitschrift für das Gesamte Bank- und Börsenwesen*, April 2005, (53), 241 – 248
25. Härdle, W.; Z. Hlavka und G. Stahl (2006) When are wrong VaR-Models adequate? *Allg. Stat. Archiv*, 90(2), 273 – 297
26. Stahl, G.; C. Wehn and A. Zapp (2006) Backtesting the Trading Book and Beyond, *Journal of Risk*, 8(2), 1 – 16
27. Kiesel, R.; Liebmann, T. and G. Stahl (2006) Integrating Market and Credit Risk, In: *Risk Management*, Ed. M. K. Ong, Academic Press 2006, 367 – 387
28. Bonti, G.; M. Kalkbrener, C. Lotz and G. Stahl (2006) Credit Risk Concentrations under Stress *Journal of Risk*, 2(3), 115–136
29. Jaschke, S.; G. Stahl and R. Stehle (2007) Evaluating VaR Models under Stress – the German Experience (accepted J. of Quantitative Finance)
30. Bongers, O. and G. Stahl (2007) *Ökonomisches Kapital und der Use Test. Risikomanagement für Investmentfonds und Hedge Fonds - Status quo vadis?*, Springer Wien New York 2007

31. Koberstein-Windpassinger, C. and G. Stahl (2007) Säulenübergreifende Prüfungsansätze der BaFin für interne Risikomodelle. *Risikomanagement für Investmentfonds und Hedge Fonds - Status quo vadis?*, Springer Wien New York 2007
32. Jaschke, S. and G. Stahl (2007) Internal Models under Solvency II, *Life & Pensions*, March 2007, pp. 36 – 40
33. Article [26] is reprinted in: *The Value-at-Risk Reference* (2007), Ed. Jon Danielsson, Risk Book

### Miscellaneous

1. Stahl, G. (1990) Anwendung der Sattelpunktmethode im Rahmen der nichtparametrischen Statistik. *Diskussionsschrift Nr. 35 des Instituts für International vergleichende Wirtschafts- und Sozialstatistik an der Universität Heidelberg* (Work under the instruction of E. Ronchetti, Geneva, for the application of an ECAS Certificate in Statistics)
2. Huschens, S. and G. Stahl (1992) Nichtparametrische Maximum Likelihood-Inferenz mit A-priori-Restriktionen. *Diskussionsschrift Nr. 179 der Wirtschaftswissenschaftlichen Fakultät der Universität Heidelberg*
3. Stahl, G. (1993) Bootstrap bei vager Vorinformation (Abstract). *Operations Research Proceedings 1993*
4. Stahl, G. Verschiedene Beiträge in den VaR-Schlaglichtern, Hrsg.: S. Huschens, Dresden
5. Stahl, G. (1999) Warum braucht ein Risikomanager den Satz von Pythagoras? In: *Forschungspolitische Dialoge in Berlin: Angewandte Mathematik - die verborgene Schlüsseltechnologie*
6. Burhoi, A. und G. Stahl (2000) Sind Risikomodelle ohne Risiko? In: *Risikomanagement an internationalen Finanzmärkten*, Hrsg.: C. A. Conrad und M. Stahl, Schäffer-Poeschel, Stuttgart
7. Overbeck, L., D. Prifti und G. Stahl (2003) Entscheidung, Prognose und Risiko bei Aktien. In *Anwaltkommentar für Aktienrecht*, 2583 – 2588, Ed.: T. Heidel, DeutscherAnwaltVerlag.
8. Stahl, G. (2004) Die regulatorischen Hürden niedrig halten *FAZ*, 13. Dezember 2004, p. 20
9. Stahl, G. (2005) Von der Produktgenehmigung zum integrierten Risikomanagement Vorwort zu dem Buch von F. Romeike und M. Müller-Reichart *Risikomanagement in Versicherungsunternehmen*, Wiley Verlag
10. Stahl, G.; Zapp, A. and S. Jaschke (2004) VaR und gut, *Risknews*, Oktober/November 2004,(1), 27 – 29
11. Huschens, S. and G. Stahl (2004) Granularität oder Korrelation, *Risknews*, Dezember/Januar 2004 , (1), 28 – 29

12. Stahl, G. (2005) Jedem das Seine *RISKNEWS* Volume 2, Issue 1 , p. 40 - 41 Published Online: 28 Jan 2005
13. Jaschke, S. und G. Stahl (2005) Solvency II – Wer lacht zuletzt?  
*Risknews*, August/September 2005, (2), 38 – 40
14. Lotz, C. and G. Stahl (2005) *Why Value at Risk holds its own* Euromoney, 36(430) 96 – 99
15. Koberstein-Windpassinger, C. und G. Stahl (2006) Alles ist Zahl,  
*Risknews* Dezember/Januar (2006), 56 – 57
16. Stahl, G. (2006) Geleitwort zu: Stresstests in Banken. Hrsg.: Klauck, Stegmann. Schäffer Poeschel Verlag.