

DR. THOMAS SIEGL

Publikationen

Artikel

- SIEGL, T., QUELL, P. (2005). Modelling Specific Interest Rate Risk with Estimation of Missing Data. *Applied Mathematical Finance*, 12 (3), 283-309. doi:10.1080/1350486042000297243.
- SIEGL, T., TICHY, R. F. (2002). A Model in Ruin Theory with derivative securities. *Mitteilungen - Bulletin / Schweizerische Aktuarvereinigung*, 2002 (1), pp. 13-30.
- SIEGL, T., WEST, A. (2001). Statistical bootstrapping methods in VaR calculation. *Applied Mathematical Finance*, 8 (3), 167-181. doi:10.1080/13504860110093504.
- SIEGL, T., BURMESTER, C. (2000). Brown'sche Brücken zum modernen Asset & Liability Management. *Die Bank*, 2000 (9), pp. 636-639.
- SIEGL, T., F. TICHY, R. (2000). Ruin theory with risk proportional to the free reserve and securitization. *Insurance: Mathematics and Economics*, 26 (1), 59-73. doi:10.1016/S0167-6687(99)00042-6.
- SIEGL, T., TICHY, R. F. (1999). A process with stochastic claim frequency and a linear dividend barrier. *Insurance: Mathematics and Economics*, 24 (1-2), 51-65. doi:10.1016/S0167-6687(98)00037-7.
- SIEGL, T., TICHY, R. F. (1998). Stochastischer Zins in der Ruintheorie. *ZAMM - Journal of Applied Mathematics and Mechanics / Zeitschrift für Angewandte Mathematik und Mechanik*, 78 (S3), 1075-1076. doi:10.1002/zamm.199807815106.
- HERENDI, T., TICHY, R. F. (1997). Fast gaussian random number generation using linear transformations. *Computing (Vienna/New York)*, 59 (2), 163-181. doi:10.1007/BF02684478.
- ASCHENWALD, D., TICHY, R. F. (1996). MAPinsure—A MAPLE Package for Life Insurance. *Journal of Symbolic Computation*, 22 (2), 227-234. doi:10.1006/jsco.1996.0050.
- SIEGL, T., TICHY, R. F. (1996). Lösungsverfahren eines Risikomodells bei exponentiell fallender Schadensverteilung. *Mitteilungen - Bulletin / Schweizerische Aktuarvereinigung*, 1996 (1), pp. 85-118.

Buchbeiträge & Kapitel

- SIEGL, T., ALM, T. (2008). Die Interne Modelle Methode (IMM) (1 ed.). In Lorenz, Hans-Peter (Eds.), *Großkredite nach GroMiKV und KWG : Neuerungen - Auslegungsfragen - Anzeigetechnik* (pp. 64-80). Köln: Bank-Verlag.
- SIEGL, T. (2003). Marktrisiken im Private Banking (1 ed.). In Philip Schädler, Marco J. Menichetti (Eds.), *Private Banking im Schlaglicht internationaler Regulierungen* (pp. 69-80). Heidelberg: Physica-Verlag.
- RANK, J., SIEGL, T. (2002). Applications of Copulas for the Calculation of Value-at-Risk (1 ed.). In Härdle, Wolfgang et. al (Eds.), *Applied Quantitative Finance* (pp. 35-50). Springer Berlin Heidelberg.
- BURMESTER, C., SIEGL, T. (2001). Strategieorientierte Simulation in der Gesamtbanksteuerung für Markt- und Kreditrisiko (1 ed.). In Eller, Gruber, Reif (Eds.), *Handbuch Gesamtbanksteuerung — Integration von Markt-, Kredit- und operationalen Risiken* (pp. 104–120). Schaeffer-Poeschel.
- SIEGL, T., WEST, A., VON ROTHKIRCH, M., DEUTSCH, H. -P. (1999). Die Erweiterung der Delta-Normal VaR Ansatzes um Nichtlineare Risiken - die Dynamic Hedge Methode (1 ed.). In Eller, Gruber und Reif (Eds.), *Handbuch Bankenaufsicht und interne Risikosteuerungsmodelle* (pp. 173-202). Schäffer-Poeschel Verlag.

BURKARD, R. E., LEITNER, H., RUDOLF, R., SIEGL, T., TABBERT, E. (1995). Discrete optimization models for treatment planning in radiation therapy (1 ed.). In Hutten, Helmut (Eds.), *Science and Technology for Medicine: Biomedical Engineering in Graz* (pp. 237-249). Lengerich: Pabst Science Publishers.