

PROF. DR. THOMAS SIEGL

Publikationen

Artikel

- SIEGL, T., STEINBERG, D. (2024). Better anti-procyclicality?. From a critical assessment of anti-procyclicality tools towards regulatory recommendations. *Journal of Risk*, online first. doi:10.21314/JOR.2023.015.
- WIRTH, T., SIEGL, T., SCHMITT, M. (2024). Is Bitcoin enough?. An analysis of passive cryptocurrency investments. *The Journal of Alternative Investments*, 26 (3), online. doi:10.3905/jai.2024.1.207.
- 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* (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. 634-639.
- SIEGL, T., TICHY, R. F. (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., SIEGL, 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., SIEGL, T., 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* (1), pp. 95-118.

Buchbeiträge & Kapitel

- ALM, T., SIEGL, 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 Schädler, P.; Menichetti, M. J. (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, W. (Eds.), *Applied quantitative finance* (pp. 35-50). Springer.
- BURMESTER, C., SIEGL, T. (2001). Strategieorientierte Simulation in der Gesamtbanksteuerung für Markt- und Kreditrisiko (1. ed.). In Eller, R.; Gruber, W.; Reif, M. (Eds.), *Handbuch Gesamtbanksteuerung*.

Integration von Markt-, Kredit- und operationalen Risiken (pp. 103–120). 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, R.; Gruber, W.; Reif, M. (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, H. (Eds.), *Science and technology for medicine. Biomedical engineering in Graz* (pp. 237-249). Lengerich: Pabst Science Publishers.