

Inhaltsverzeichnis

Überblick über analytische und kreative Methoden für Risiko-Management	9
Vorwort und Einführung	11
Regeln für berufliches und privates Risiko-Management	17
I. In der Retrospektive: Risiko-Management vom Orakel von Delphi bis heute	21
1. Vom Glücksspiel zum modernen Risikobegriff	21
2. Fortuna und Gewissheit	25
3. Das Orakel als Risikomanager	26
4. Wahrnehmung des Individuums von Vergangenheit und Zukunft	29
5. Die Entstehung des modernen Risikobegriffs	31
6. Die historischen Wurzeln des Risiko-Managements	32
7. Wahrscheinlichkeitsrechnung als Grundlage des modernen Risiko-Managements	43
8. Ein Wunderkind revolutioniert die Methoden des Risiko-Managements	59
9. Die Theorie des Zufalls von Laplace	62
10. Galtons Modell zur Demonstration von Wahrscheinlichkeitsverteilungen	64
11. Der unterschätzte Wegbereiter in der Theorie der stochastischen Prozesse	67
12. Ein neues Verständnis der Ungewissheit	72
II. Komplexität als Ursache steigender Risiken in Industrie und Handel	81
1. Veränderte Risikolage für Industrie- und Handelsunternehmen	81
2. Komplexität als Ursache von Risiken	85
3. Kritische Beurteilung und Ausblick	97

III. Wert- und risikoorientierte Unternehmensführung	97
1. Grundlagen einer wert- und risikoorientierten Unternehmensführung	97
2. Die Risikolandkarte im Unternehmen	97
3. Der Prozess des Risiko-Managements in der Praxis	97
4. Anforderungen an die Organisation des Risiko-Managements im Unternehmen	97
5. Fazit und Ausblick	97
IV. Strategische Chancen und Risiken von Investitionen	97
1. Lessons learned: Konkurrenz für die Post – Erschließung neuer Märkte	97
2. Methoden: Strategische Chancen und Risiken erkennen	97
V. Risiko-Management von Preisen im Einkauf und Verkauf	97
1. Lessons learned: Schwankende Marktpreise	97
2. Wertorientierte versus zahlungsstromorientierte Messung	97
3. Szenariogenerierung für Marktpreisrisiken	97
4. Fallstudie: Management von Marktpreisrisiken im Einkauf	97
5. Risikomessung mit Cash Flow at Risk, EBIT at Risk und Budget at Risk	97
VI. Risiko-Management in der Produktion	97
1. Risiko-Management im Kontext von Supply Chain Management	97
2. Verwundbarkeit der Wertschöpfungsketten am Beispiel der Automobilindustrie	97
3. Methodenbaukasten	97
4. Krisenmanagement	97
VII. Der Chancen-/Risikofaktor Personal	97
1. Talente binden – Personalrisiken frühzeitig erkennen	97
2. Die Chancen-/Risikobeurteilung im Personalbereich	97
3. Chancen fördern, Personalrisiken reduzieren	97

VIII. Quantifizierung von Risiken im Finanzbereich	97
1. Das Drei-Werte-Verfahren.....	97
2. Das Varianz-Kovarianz-Modell.....	97
3. Die Historische Simulation	97
4. Die Monte-Carlo-Simulation.....	97
IX. Marken- und Vertriebsrisiken	97
1. Wie sich der Wert eines Unternehmens zusammensetzt	97
2. Marken- und Vertriebsrisiko-Management	97
X. Risiko-Management in der Informations- und Kommunikationstechnologie (IuK)	97
1. Risiken in der Welt der Bits und Bytes	97
2. Wichtige Regelwerke der Informationssicherheit und des IT-Risiko-Managements.....	97
3. IT-Krisen- und Notfallmanagement	97
XI. Risiko-Management in Projekten.....	97
1. Projekt und Projektmanagement	97
2. Die häufigsten Hürden und Stolperfallen.....	97
3. Strategisches Projektcontrolling.....	97
4. Bewertung von Risiken und Chancen von Projekten.....	97
5. Projektsteuerung und Projektkontrolle.....	97
6. Standards und Normen im Bereich Projektmanagement	97
XII. Mathematische Grundlagen	97
1. Modellierung von Risikoprozessen als Random Walk.....	97
2. Von der Normalverteilung zum Value at Risk.....	97
3. Die Prüfung einer Verteilungsannahme.....	97
4. Parametrisierung von Risikomodellen	97
5. Risikodiversifikation mit Korrelationen.....	97
6. Cash Flow at Risk versus Value at Risk.....	97

Glossar	97
Stichwortverzeichnis.....	97
Die Autoren.....	97