

# Inhaltsverzeichnis

---

Überblick über analytische und kreative Methoden für Risiko-Management .....	9
Vorwort und Einführung.....	11
Regeln für berufliches und privates Risiko-Management.....	17
<b>I. In der Retrospektive: Risiko-Management vom Orakel von Delphi bis heute .....</b>	<b>21</b>
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
<b>II. Komplexität als Ursache steigender Risiken in Industrie und Handel .....</b>	<b>81</b>
1. Veränderte Risikolage für Industrie- und Handelsunternehmen .....	81
2. Komplexität als Ursache von Risiken .....	85
3. Kritische Beurteilung und Ausblick .....	97

<b>III. Wert- und risikoorientierte Unternehmensführung .....</b>	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
<b>IV. Strategische Chancen und Risiken von Investitionen .....</b>	97
1. Lessons learned: Konkurrenz für die Post – Erschließung neuer Märkte .....	97
2. Methoden: Strategische Chancen und Risiken erkennen.....	97
<b>V. Risiko-Management von Preisen im Einkauf und Verkauf.....</b>	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
<b>VI. Risiko-Management in der Produktion.....</b>	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
<b>VII. Der Chancen-/Risikofaktor Personal.....</b>	97
1. Talente binden – Personalrisiken frühzeitig erkennen.....	97
2. Die Chancen-/Risikobeurteilung im Personalbereich.....	97
3. Chancen fördern, Personalrisiken reduzieren .....	97

<b>VIII. Quantifizierung von Risiken im Finanzbereich .....</b>	97
1. Das Drei-Werte-Verfahren.....	97
2. Das Varianz-Kovarianz-Modell.....	97
3. Die Historische Simulation .....	97
4. Die Monte-Carlo-Simulation.....	97
<b>IX. Marken- und Vertriebsrisiken .....</b>	97
1. Wie sich der Wert eines Unternehmens zusammensetzt .....	97
2. Marken- und Vertriebsrisiko-Management .....	97
<b>X. Risiko-Management in der Informations- und Kommunikationstechnologie (IuK) .....</b>	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
<b>XI. Risiko-Management in Projekten.....</b>	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
<b>XII. Mathematische Grundlagen .....</b>	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