
Inhaltsverzeichnis

Überblick über analytische und kreative Methoden für Risiko-Management	XV
---	-----------

Regeln für berufliches und privates Risiko-Management	XVII
--	-------------

1 In der Retrospektive: Risiko-Management vom Orakel von Delphi bis heute	1
1.1 Vom Glücksspiel zum modernen Risikobegriff	2
1.2 Fortuna und Gewissheit	5
1.3 Das Orakel als Risikomanager	7
1.4 Wahrnehmung des Individuums von Vergangenheit und Zukunft	9
1.5 Die Entstehung des modernen Risikobegriffs	11
1.6 Die historischen Wurzeln des Risiko-Managements	12
1.7 Wahrscheinlichkeitsrechnung als Grundlage des modernen Risiko-Managements	18
1.8 Ein Wunderkind revolutioniert die Methoden des Risiko-Managements .	36
1.9 Die Theorie des Zufalls von Laplace	39
1.10 Galtons Modell zur Demonstration von Wahrscheinlichkeitsverteilungen	42
1.11 Der unterschätzte Wegbereiter in der Theorie der stochastischen Prozesse	44
1.12 Ein neues Verständnis der Ungewissheit	49
Literatur	52
2 Komplexität als Ursache steigender Risiken in Industrie und Handel	55
2.1 Veränderte Risikolage für Industrie- und Handelsunternehmen	56
2.2 Komplexität als Ursache von Risiken	64
2.3 Kritische Beurteilung und Ausblick	81
Literatur	82
3 Wert- und risikoorientierte Unternehmensführung	85
3.1 Grundlagen einer wert- und risikoorientierten Unternehmensführung . .	86
3.2 Die Risikolandkarte im Unternehmen	89
3.3 Der Prozess des Risiko-Managements in der Praxis	94

3.4	Anforderungen an die Organisation des Risiko-Managements im Unternehmen	146
3.5	Fazit und Ausblick	152
	Literatur	156
4	Strategische Chancen und Risiken von Investitionen	159
4.1	Lessons learned: Konkurrenz für die Post – Erschließung neuer Märkte .	160
4.2	Mission, Vision, Strategie	163
4.3	Methoden: Strategische Chancen und Risiken erkennen	174
	Literatur	188
5	Bandbreitenplanung im Einkauf und Verkauf	191
5.1	Lessons learned: Schwankende Marktpreise	192
5.2	Wertorientierte versus zahlungsstromorientierte Messung	193
5.3	Simulation von Bandbreiten für Marktpreisrisiken	201
5.4	Fallstudie: Management von Marktpreisrisiken im Einkauf	217
5.5	Risikomessung mit Cash Flow at Risk, EBIT at Risk und Budget at Risk .	221
	Literatur	231
6	Risiko-Management in der Produktion	233
6.1	Risiko-Management im Kontext von Supply Chain Management	234
6.2	Verwundbarkeit der Wertschöpfungsketten am Beispiel der Automobilindustrie	238
6.3	Methodenbaukasten	245
6.4	Krisenmanagement	274
	Literatur	280
7	Der Chancen-/Risikofaktor Personal	285
7.1	Talente binden – Personalrisiken frühzeitig erkennen	286
7.2	Die Chancen-/Risikobeurteilung im Personalbereich	288
7.3	Chancen fördern, Personalrisiken reduzieren	294
7.4	Quantifizierung „weicher“ Risikofaktoren	300
	Literatur	304
8	Quantifizierung von Risiken im Finanzbereich	307
8.1	Das Drei-Werte-Verfahren	308
8.2	Das Varianz-Kovarianz-Modell	313
8.3	Die Historische Simulation	329
8.4	Die Monte-Carlo-Simulation	339
	Literatur	352

9	Marken- und Vertriebsrisiken	355
9.1	Wie sich der Wert eines Unternehmens zusammensetzt	356
9.2	Marken- und Vertriebsrisiko-Management	368
	Literatur	370
10	Risiko-Management in der Informations- und Kommunikationstechnologie (IuK)	373
10.1	Risiken in der Welt der Bits und Bytes	374
10.2	Wichtige Regelwerke der Informationssicherheit und des IT-Risiko-Managements	381
10.3	IT-Krisen- und Notfallmanagement	396
	Literatur	406
11	Risiko-Management in Projekten	409
11.1	Projekt und Projektmanagement	410
11.2	Die häufigsten Hürden und Stolperfallen	414
11.3	Strategisches Projektcontrolling	418
11.4	Bewertung von Risiken und Chancen von Projekten	420
11.5	Projektsteuerung und Projektkontrolle	425
11.6	Standards und Normen im Bereich Projektmanagement	425
	Literatur	429
12	Mathematische Grundlagen	431
12.1	Modellierung von Risikoprozessen als Random Walk	432
12.2	Von der Normalverteilung zum Value at Risk	438
12.3	Die Prüfung einer Verteilungsannahme	446
12.4	Parametrisierung von Risikomodellen	455
12.5	Risikodiversifikation mit Korrelationen	476
12.6	Cash Flow at Risk versus Value at Risk	482
	Literatur	491
	Die Autoren	495
	Glossar	497
	Sachverzeichnis	521