

Grundlagen des Risikomanagements

**Mit fundierten Informationen
zu besseren Entscheidungen**

von

Prof. Dr. Werner Gleißner

3., vollständig überarbeitete und erweiterte Auflage

Verlag Franz Vahlen München

Inhaltsübersicht

Vorwort und Einleitung	V
Inhaltsverzeichnis	XIII
Symbolverzeichnis	XXIII
1. Die Welt der Chancen und Gefahren	1
2. Unternehmensstrategie, Risikopolitik und Risikokultur	87
3. Risikoanalyse	99
4. Risikoaggregation, Gesamtrisikoumfang und stochastische Planung	245
5. Risikobewältigung und Risikosteuerung	283
6. Risikoinformationen für unternehmerische Entscheidungen: Rating, Controlling und wertorientierte Unternehmensführung	325
7. Risikoüberwachung, Controlling und die Organisation des Risikomanagements	417
8. Zusammenfassung	525
Anhang 1: Stochastische Prozesse und Zeitreihenanalysen	531
Anhang 2: Extremwerttheorie	537
Anhang 3: Kernthesen der Wertorientierung und ihre Konsequenzen für das unternehmensweite Risikomanagement	539
Anhang 4: Unvollkommene Märkte, Rating, Risiko und Wert –näher betrachtet	545
Anhang 5: Quantifizierung von Bewertungsrisiken über „Bewertungs-Multiples“	553
Anhang 6: Fallbeispiel: Beurteilung und Bewältigung des Gesamtrisikoumfangs eines Bau-Projekts	559
Anhang 7: Regressionsmodell und Parameterschätzung	565
Literatur	567
Stichwortverzeichnis	603