

Frank Romeike /Peter Hager

Erfolgsfaktor Risiko-Management 2.0

Methoden, Beispiele, Checklisten
Praxishandbuch für Industrie
und Handel

2., vollständig überarbeitete
und erweiterte Auflage



!HOCHSCHULE
LIECHTENSTEIN
Bibliothek

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 undZukunft..... | 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..... | 98 |

| | |
|--|-----|
| III. Wert- und risikoorientierte Unternehmensführung | 105 |
| 1. Grundlagen einer wert- und risikoorientierten Unternehmensführung..... | 105 |
| 2. Die Risikolandkarte im Unternehmen..... | 109 |
| 3. Der Prozess des Risiko-Managements in der Praxis..... | 114 |
| 4. Anforderungen an die Organisation des Risiko-Managements im Unternehmen..... | 167 |
| 5. Fazit und Ausblick..... | 173 |
| IV. Strategische Chancen und Risiken von Investitionen | 181 |
| 1. Lessons learned: Konkurrenz für die Post - Erschließung neuer Märkte..... | 181 |
| 2. Methoden: Strategische Chancen und Risiken erkennen..... | 184 |
| V. Risiko-Management von Preisen im Einkauf und Verkauf,..... | 203 |
| 1. Lessons learned: Schwankende Marktpreise..... | 203 |
| 2. Wertorientierte versus zahlungsstromorientierte Messung..... | 204 |
| 3. Szenariogenerierung für Marktpreisrisiken..... | 213 |
| 4. Fallstudie: Management von Marktpreisrisiken im Einkauf..... | 227 |
| 5. Risikomessung mit CashFlow at Risk, EBIT at Risk und Budget at Risk..... | 231 |
| VI. Risiko-Management in der Produktion | 245 |
| 1. Risiko-Management im Kontext von Supply Chain Management..... | 245 |
| 2. Verwundbarkeit der Wertschöpfungsketten am Beispiel der Automobilindustrie..... | 250 |
| 3. Methodenbaukasten..... | 255 |
| 4. Krisenmanagement..... | 283 |
| VII. Der Chancen-/Risikofaktor Personal... | 295 |
| 1. Talente binden - Personalrisiken frühzeitig erkennen..... | 295 |
| 2. Die Chancen-/Risikobeurteilung im Personalbereich..... | 298 |
| 3. Chancen fördern, Personalrisiken reduzieren..... | 305 |

| | |
|--|-----|
| VIII. Quantifizierung von Risiken im Finanzbereich | 311 |
| 1. Das Drei-Werte-Verfahren..... | 311 |
| 2. Das Varianz-Kovarianz-Modell..... | 317 |
| 3. Die Historische Simulation..... | 334 |
| 4. Die Monte-Carlo-Simulation..... | 345 |
| IX. Marken- und Vertriebsrisiken | 363 |
| 1. Wie sich der Wert eines Unternehmens zusammensetzt..... | 363 |
| 2. Marken- und Vertriebsrisiko-Management..... | 368 |
| X. Risiko-Management in der Informations- und Kommunikationstechnologie (IuK) | 373 |
| 1. Risiken in der Welt der Bits und Bytes..... | 373 |
| 2. Wichtige Regelwerke der Informationssicherheit und des IT-Risiko-Managements..... | 380 |
| 3. IT-Krisen- und Notfallmanagement..... | 395 |
| XI. Risiko-Management in Projekten | 405 |
| 1. Projekt und Projektmanagement..... | 405 |
| 2. Die häufigsten Hürden und Stolperfallen..... | 409 |
| 3. Strategisches Projektcontrolling..... | 414 |
| 4. Bewertung von Risiken und Chancen von Projekten..... | 416 |
| 5. Projektsteuerung und Projektkontrolle..... | 421 |
| 6. Standards und Normen im Bereich Projektmanagement..... | 421 |
| XII. Mathematische Grundlagen | 429 |
| 1. Modellierung von Risikoprozessen als Random Walk..... | 429 |
| 2. Von der Normalverteilung zum Value at Risk..... | 435 |
| 3. Die Prüfung einer Verteilungsannahme..... | 444 |
| 4. Parametrisierung von Risikomodellen..... | 454 |
| 5. Risikodiversifikation mit Korrelationen..... | 477 |
| 6. Cash Flow at Risk versus Value at Risk..... | 483 |

| | |
|---------------------------|-----|
| Glossar..... | 497 |
| Stichwortverzeichnis..... | 519 |
| Die Autoren..... | 527 |