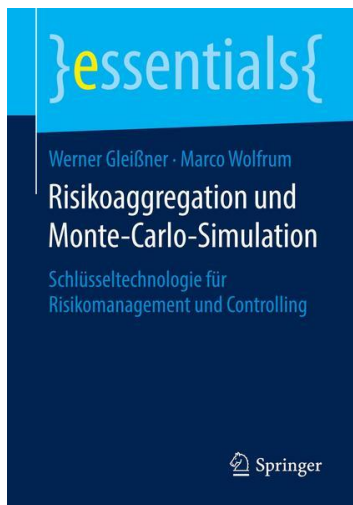




Risikoaggregation und Monte-Carlo-Simulation

Schlüsseltechnologie für Risikomanagement und Controlling

Werner Gleißner / Marco Wolfrum

1. Aufl. 2019

56 Seiten

SpringerGabler Verlag, Wiesbaden

ISBN 978-3-658-24273-2

14,99 € (Softcover)

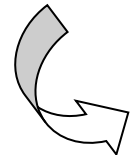
4,99 € (eBook)

**Erhältlich im Buchhandel oder bei
FutureValue Group AG**

essentials liefern aktuelles Wissen in konzentrierter Form. Die Essenz dessen, worauf es als „State-of-the-Art“ in der gegenwärtigen Fachdiskussion oder in der Praxis ankommt. *essentials* informieren schnell, unkompliziert und verständlich

- als Einführung in ein aktuelles Thema aus Ihrem Fachgebiet
- als Einstieg in ein für Sie noch unbekanntes Themenfeld
- als Einblick, um zum Thema mitreden zu können

**Bestellbogen auf
der Rückseite**



Dieser Band stellt praxisorientiert die Monte-Carlo-Simulation (Risikosimulation) vor, die es ermöglicht, den Gesamtrisikoumfang eines Unternehmens oder Projektes zu berechnen (Risikoaggregation) und mögliche „bestandsgefährdende Entwicklungen“ aus Kombinationseffekten von Einzelrisiken zu erkennen (Kernanforderung an ein Risikomanagement nach §91 Abs. 2 AktG). Ausgehend von einer Einführung zu Risikoanalyse und Risikoquantifizierung wird gezeigt, wie durch die Verbindung von Unternehmensplanung und Risikoanalyse mittels Monte-Carlo-Simulation eine Risikoaggregation durchgeführt wird (mit Excel und der Simulationssoftware Crystal Ball).

Der Inhalt

- Grundlagen des Risikomanagements
- Risikoquantifizierung als Grundlage der Risikoaggregation
- Risikoaggregation: Bestimmung des „Grads der Bestandsbedrohung“ und des Gesamtrisikoumfangs
- Anwendung der Risikoaggregation: Messung der Risikotragfähigkeit

Die Zielgruppen

- Dozierende und Studierende der Betriebswirtschaftslehre, des Wirtschaftsingenieurwesens und der Wirtschaftsmathematik
- Praktiker aus Controlling, Risikomanagement und Unternehmensplanung

Die Autoren

Prof. Dr. Werner Gleißner ist Vorstand FutureValue Group AG und EACVA sowie Professor für Betriebswirtschaft, insb. Risikomanagement, an der Technischen Universität Dresden. Er befasst sich mit der Integration von Risikomanagement, Rating- und Unternehmensbewertungstheorie.

Marco Wolfrum ist Partner und Senior Analyst der FutureValue Group im Bereich Financial Modelling, Risikomanagement, Rating und Unternehmensbewertung.

Bestellfax an:
0711 / 79 73 58-58

FutureValue Group AG
Obere Gärten 18
70771 Leinfelden-Echterdingen

- ☐ Ich bestelle: „Risikoaggregation und Monte-Carlo-Simulation“
als Softcover zum Preis von 14,99 €/Stück

Senden Sie mir bitte Exemplar/e an

Firma
Name, Vorname
Abteilung
Straße
PLZ Ort
Telefon / Fax
eMail

Unterschrift

Ich möchte vom kostenlosen Informations-Service profitieren!

- ☐ Bitte senden Sie mir Fachartikel zum Thema
- ☐ „Risikomanagement“
 - ☐ „strategische und wertorientierte Unternehmensführung“
 - ☐ „Rating & Finanzierung“
 - ☐ „Controlling und Unternehmensplanung“
 - ☐ „Nachhaltigkeit“

Für Rückfragen steht Ihnen Frau Tina Dutschmann-Schwarzkopf unter der Telefonnummer
0711/ 79 73 58 - 36 oder per E-Mail **t.dutschmann@futurevalue.de** gern zur Verfügung.