
Inhaltsverzeichnis

- 1 Einführung in das Risikomanagement bei Unternehmen** 1
 - 1.1 Einführung in das Risikomanagement 2
 - 1.2 Nachhaltigkeit und Risikomanagement 4
 - 1.3 Innovationsmanagement und Risikomanagement 6
 - 1.4 Compliance und Risikomanagement 8
 - 1.5 Corporate Governance und Risikomanagement 8
 - 1.6 Weitere rechtliche Aspekte 9
- 2 Strategisches Risikomanagement bei Unternehmen** 11
 - 2.1 Risikomanagement und Controlling 11
 - 2.2 Einbettung des Risikomanagements ins Unternehmen 13
 - 2.3 Instrumente des strategischen Risikomanagements 15
 - 2.3.1 Aufbau eines Risikohandbuchs 16
 - 2.3.2 Einsatz einer Risikomanagement-Software 18
 - 2.3.3 Asset-Liability-Management 20
- 3 Operatives Risikomanagement bei Unternehmen** 25
 - 3.1 Risikoidentifikation 25
 - 3.1.1 Risikoarten bei finanziellen Risiken 27
 - 3.1.2 Risikoarten bei operationalen Risiken 31
 - 3.1.3 Strukturierung der Risiken mit Hilfe eines Risikoschemas 35
 - 3.2 Risikobewertung 36
 - 3.2.1 Marktrisiken (Preis- und Wertänderungen) 37
 - 3.2.2 Asset-Liability-Matching 52
 - 3.2.3 Kredit- und Ausfallrisiken 58
 - 3.2.4 Gesamtrisiken 65
 - 3.3 Risikocontrolling 78
 - 3.3.1 Steuerung mithilfe der Risk Map 79
 - 3.3.2 Steuerung mithilfe der Durationslücke 80

3.3.3	Constant Proportion Portfolio Insurance (CPPI)	83
3.3.4	Einsatz derivativer Instrumente	86
3.4	Risikoüberwachung	87
3.4.1	Risikoberichte	87
3.4.2	Stresstests	91
4	Solvabilität und Risikomanagement	95
4.1	Eigenkapitalvorschriften bei Banken bedingt durch Basel II und Basel III	95
4.2	Eigenkapitalvorschriften bei Versicherungen durch Solvency II	103
4.3	Vergleich der Aufsichtssysteme	109
Anhang	111
Literaturverzeichnis	117
Sachverzeichnis	123



<http://www.springer.com/978-3-642-36688-8>

Corporate Risk Management

Wengert, H.; Schittenhelm, F.A.

2013, XVII, 125 S. 61 Abb., Softcover

ISBN: 978-3-642-36688-8