

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|------------|
| 1 Einführung | 1 |
| 2 Die Problemstellung und ihre Einordnung | 5 |
| 2.1 Problemstellung | 5 |
| 2.2 Die Einordnung der Problemstellung in die Entscheidungstheorie | 11 |
| 2.3 Die Einordnung der Problemstellung in den Risikomanagement- Prozess | 22 |
| 3 Moderne Methoden der Risikomessung – Risiko als eigenständiges Konzept | 25 |
| 3.1 Grundlagen | 25 |
| 3.2 Traditionelle Risikomaße | 30 |
| 3.3 Kohärente Risikomaße | 66 |
| 3.4 Eine Subklasse kohärenter Risikomaße: Spektrale Risikomaße | 151 |
| 3.5 Konyexe Risikomaße | 187 |
| 3.6 Zwischenfazit | 237 |
| 4 Moderne Methoden der Präferenzmessung – Bestimmung optimaler Lösungen | 239 |
| 4.1 Grundlagen | 239 |
| 4.2 Traditionelle Entscheidungsprinzipien | 243 |
| 4.3 Moderne Entscheidungsprinzipien | 275 |
| 4.4 Kompatibilität von traditionellen und modernen Entscheidungs- prinzipien | 287 |
| 4.5 Ein klassisches Anwendungsbeispiel: Die Portfoliotheorie | 293 |
| 4.6 Ein weiteres Anwendungsbeispiel: Das Newsvendor-Modell | 340 |
| 4.7 Zwischenfazit | 350 |
| 5 Zusammenfassung | 353 |
| Literaturverzeichnis | 359 |