

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 Konvexe 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 Entscheidungsprinzipien	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