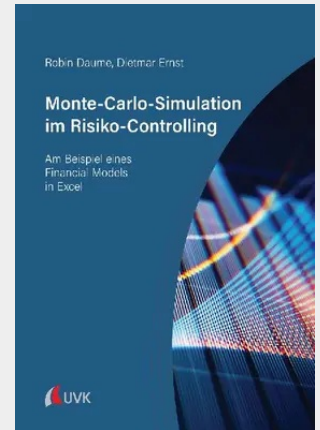


## Monte-Carlo-Simulation im Risiko-Controlling

Am Beispiel eines Financial Models in Excel

Das Risiko-Controlling dient als Unterstützungsfunktion für das Risikomanagement und die Unternehmensführung. Es stellt Informationen, Instrumente und Prozesse für den Umgang mit Risiken bereit. Prüfungsstandards wie der IDW PS 340, das StaRUG und das FISG verpflichten Unternehmen, ein Risikofrüherkennungssystem einzurichten und dabei Risiken zu identifizieren, zu quantifizieren und zu aggregieren. Die Risikoaggregation ist somit eine wesentliche Anforderung an ein modernes Risikomanagementsystem. Mit der Risikoaggregation wird das Ziel verfolgt, die Gesamtrisikoposition eines Unternehmens zu bestimmen und die Kombinationseffekte der Einzelrisiken zu erfassen. Dies kann nur durch eine Risikosimulation im Sinne der Monte-Carlo-Simulation gewährleistet werden. Ziel dieses Buches ist es, am Beispiel eines Financial Model in Excel zu zeigen, wie die Monte-Carlo-Simulation im Risiko-Controlling praxisnah angewendet werden kann.

Das Risiko-Controlling dient als Unterstützungsfunktion für das Risikomanagement und die Unternehmensführung. Es stellt Informationen, Instrumente und Prozesse für den Umgang mit Risiken bereit. Prüfungsstandards wie der IDW PS 340, das StaRUG und das FISG verpflichten Unternehmen, ein Risikofrüherkennungssystem einzurichten und dabei Risiken zu identifizieren, quantifizieren und zu aggregieren. Die Risikoaggregation ist somit eine wesentliche Anforderung an ein modernes Risikomanagementsystem. Mit der Risikoaggregation wird das Ziel verfolgt, die Gesamtrisikoposition eines Unternehmens zu bestimmen und die Kombinationseffekte der Einzelrisiken zu erfassen. Dies kann nur durch eine Risikosimulation im Sinne der Monte-Carlo-Simulation gewährleistet werden. Ziel dieses Buches ist es, am Beispiel eines Financial Models in Excel zu zeigen, wie die Monte-Carlo-Simulation im Risiko-Controlling praxisnah angewendet werden kann. Dazu haben die Autoren eine Fallstudie erarbeitet, die nachvollziehbar aufzeigt, wie die einzelnen Schritte der Quantifizierung, Aggregation und Risikoauswertung in einem Business Plan umgesetzt werden können.



**24,99 €**

23,36 € (zzgl. MwSt.)

*sofort versandfertig, Lieferzeit: 1-3  
Werktage*

**Artikelnummer:** 9783739832005

**Medium:** Buch

**ISBN:** 978-3-7398-3200-5

**Verlag:** UvK Verlag

**Erscheinungstermin:** 01.03.2022

**Sprache(n):** Deutsch

**Auflage:** 1. Auflage 2022

**Produktform:** Kartoniert

**Gewicht:** 247 g

**Seiten:** 144

**Format (B x H):** 146 x 212 mm

