

1. Record Nr.	UNINA9910563185903321
Autore	Rietsch Martin
Titolo	Messung und Analyse des ökonomischen Wechselkursrisikos aus Unternehmenssicht: Ein stochastischer Simulationsansatz / Wirtschaftsuniversität Wien, Martin Rietsch
Pubbl/distr/stampa	Frankfurt a.M. : PH02, 2018 2018, c2008
Edizione	[1st, New ed.]
Descrizione fisica	1 online resource (341 p.) : , EPDF
Collana	Forschungsergebnisse der Wirtschaftsuniversitat Wien ; 21
Soggetti	Economic theory & philosophy Monetary economics
Lingua di pubblicazione	Tedesco
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Note generali	Peter Lang GmbH, Internationaler Verlag der Wissenschaften
Nota di contenuto	Aus dem Inhalt: Wechselkursrisiko - Wechselkursrisiko-Konzepte - Economic Exposure - Messung des ökonomischen Wechselkursrisikos - Wechselkurs-Risikomanagement - Simulationsmethode - Unternehmensmodell - Szenariensimulator - Analyse von risikopolitischen Gegenmaßnahmen - Verifikation eines Simulationsmodells - Validierung eines Simulationsmodells - Simulationsstudie.
Sommario/riassunto	Die Arbeit wendet sich zunächst den Grundlagen zum Konzept des ökonomischen Wechselkursrisikos und der Simulationsmethodik zu, bevor ein bestehender Corporate Modelling-Ansatz zu einem stochastischen Simulationsmodell erweitert und schließlich in einem umfangreichen Computerprogramm implementiert wird. Nach einer Darstellung zur Verifikation und Validierung des vorgeschlagenen Simulationsmodells wird abschließend die Anwendung des Computersimulations-Modells für den praktischen Einsatz demonstriert. Dazu werden, basierend auf einem hypothetischen Unternehmen, ein ökonomisches Wechselkursrisiko sowie risikopolitische Gegenmaßnahmen in einem Probelauf gemessen und analysiert.