

RC110 Moderne Methoden der Risikoquantifizierung

Kurzbeschreibung:

Das Seminar vermittelt Methodenkompetenz in quantitativen Verfahren zur Risikomessung in Industrie und Handel.

Zur Quantifizierung von Risiken stehen zahlreiche Instrumente und Methoden bereit. Diese wurden in den letzten Jahren kontinuierlich verbessert und verfeinert.

Im Seminar erlernen Sie klassische Value-at-Risk-Ansätze ebenso wie moderne stochastische Simulationsverfahren. Zur integrierten Betrachtung von Risiken und Chancen werden diverse Risiko-Kennzahlen vorgestellt und diskutiert.

Zielgruppe:

Fortgeschrittene im Thema Risikomanagement, Risikomanager, Controller, Revision und Geschäftsführung, die tiefer in die quantitative Methodenwelt einsteigen möchten.

Voraussetzungen:

Mathematische Grundkenntnisse, jedoch keine statistischen Vorkenntnisse nötig.

Sonstiges:

Dauer: 2 Tage

Preis: 1590 Euro plus Mwst.

Ziele:

Erlernen Sie in diesem Seminar einen praxisbewährten Methodenbaukasten zur Risikoquantifizierung in Ihrem Unternehmen.

In diesem Seminar werden keine statistischen Vorkenntnisse erwartet.

Inhalte/Agenda:

- Sie lernen in diesem Seminar die folgenden Aspekte kennen:
 - ◆ Grundlagen der Statistik
 - ◆ Zeitreihenanalyse
 - ◆ Alternative Verteilungen und deren Parametrisierungen
 - ◆ Anwendung der im Finanzbereich bewährten "Value-at-Risk"-Modelle
 - ◆ Anwendung von stochastischen Szenarioanalysen auf geplante Cash Flows, Budgets und erwartete Gewinne
 - ◆ Bandbreitenplanung in der Praxis
 - ◆ Beachtung von Abhängigkeiten zwischen Risiken (natural hedges)
 - ◆ Risiko-Reporting: lesbare und aussagefähige Risikokennzahlen
 - ◆ Unterstützung durch Fallstudien in Excel und Verwendung von Add-Ins
 - ◆ Entwicklung diverser eigener Werkzeuge für die Praxis (eigenes Notebook erforderlich)

- **Zusätzlich erhalten alle Teilnehmer das Buch "Erfolgsfaktor Risiko-Management 3.0" (Springer Verlag 2013)**