

## ***RC116 Quantitative Methoden im Risikomanagement***

### **Kurzbeschreibung:**

Teilnehmende erhalten eine praxisnahe Einführung in quantitative Verfahren der Risikomessung. Vermittelt werden klassische Value-at-Risk-Ansätze, moderne stochastische Simulationsverfahren und Risiko-Kennzahlen zur integrierten Betrachtung von Risiken und Chancen. Behandelt werden zudem Visualisierungen und anwendungsorientierte Methoden zur Risikoanalyse und Risikoaggregation für Industrie, Handel und Dienstleistungen.

### **Zielgruppe:**

Einsteiger und Fortgeschrittene im Thema "Quantitative Methoden", Risikomanager, Treasurer, Controller, Projektleiter und Projektmanager, Risk Owner (dezentrale Risikoverantwortliche), Revisoren, Qualitätsmanager und Geschäftsführung bzw. Aufsichtsratsmitglieder.

### **Voraussetzungen:**

In diesem Seminar werden keine statistischen Vorkenntnisse vorausgesetzt.

### **Sonstiges:**

**Dauer:** 2 Tage

**Preis:** 1790 Euro plus Mwst.

### **Ziele:**

Erlernen Sie im Seminar **RC116 Quantitative Methoden im Risikomanagement** einen praxisbewährten Methodenbaukasten zur Risikoquantifizierung in Ihrem Unternehmen. In diesem Seminar werden keine statistischen Vorkenntnisse vorausgesetzt.

#### Inhalte/Agenda:

- ♦ Grundlagen der Statistik
- ♦ Zeitreihenanalyse
- ♦ Alternative Verteilungen und deren Parametrisierungen (univariate und multivariate)
- ♦ Anwendung der im Finanzbereich bewährten "Value-at-Risk"-Modelle
- ♦ Anwendung von stochastischen Szenarioanalysen auf geplante Cash Flows, Budgets und erwartete Gewinne (Cash Flow at Risk, EBIT at Risk)
- ♦ Bandbreitenplanung in der Praxis
- ♦ Beachtung von Abhängigkeiten zwischen Risiken
- ♦ Risiko-Reporting: lesbare und aussagefähige Risikokennzahlen
- ♦ Unterstützung durch Fallstudien in Excel und Verwendung von Add-Ins
- ♦ Umsetzung eines quantitativen Risikomanagements in R oder Python
- ♦ Entwicklung diverser eigener Werkzeuge für die Praxis in MS Excel und R (eigenes Notebook mit Excel-Installation sinnvoll)