

RC116 Quantitative Methoden im Risikomanagement

Kurzbeschreibung:

Das Seminar vermittelt Methodenkompetenz in quantitativen Verfahren zur Risikomessung in allen Branchen (mit einem Schwerpunkt auf Industrie, Handel und Dienstleistungen). 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 praxistaugliche Risiko-Kennzahlen vorgestellt und diskutiert. Das Intensiv-Seminar bietet damit einer anwenderorientierte Vermittlung mathematischer/statistischer Methoden der Risikoanalyse und Risikoaggregation.

Alle Teilnehmer erhalten eine umfangreiche Dokumentation in gedruckter und elektronischer Form (USB-Stick). Außerdem erhalten alle Teilnehmer das Buch Stochastische Szenariosimulation in der Unternehmenspraxis Risikomodellierung, Fallstudien, Umsetzung in R (Romeike/Stallinger, Springer Verlag 2021) sowie ein Zertifikat der Risk Academy®.

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:

-

Sonstiges:

Dauer: 2 Tage

Preis: 1690 Euro plus Mwst.

Ziele:

Erlernen Sie in diesem Seminar einen praxisbewährten Methodenbaukasten zur Risikoquantifizierung in Ihrem Unternehmen. In diesem Seminar werden keine statistischen Vorkenntnisse vorausgesetzt. Außerdem erhalten beim virtuellen Training alle Teilnehmer ein einstündiges individuelles Coaching (online oder telefonisch) zur Vertiefung oder zur Klärung konkreter Fragen bei der Umsetzung in der Praxis.

Inhalte/Agenda:

- Sie lernen in diesem Seminar die folgenden Aspekte kennen:
 - ◆ Grundlagen der Statistik
 - ◆ Zeitreihenanalysen
 - ◆ 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
 - ◆ Entwicklung diverser eigener Werkzeuge für die Praxis in Excel und R (eigenes Notebook mit Excel-Installation sinnvoll)