RC136 Risikoaggregation in der Praxis

Kurzbeschreibung:

Führungskräfte und Verantwortliche im Risikomanagement lernen Methoden zur Aggregation von Risiken und deren Anwendung in Case Studies kennen. Vermittelt wird ein praxisorientierter Ansatz zur Entwicklung eines Risikotragfähigkeitskonzepts, der u.a. Anforderungen aus IDW PS 340 und dem DIIR Revisionsstandard Nr. 2 erfüllt. Das Training beinhaltet umfangreiche Unterlagen, ein Fachbuch sowie ein Zertifikat der Risk Academy.

Zielgruppe:

Risikomanager, Geschäftsführer, Wirtschaftsprüfer, Mitarbeiter aus den Bereichen Controlling, Informationssicherheit, Security, Qualitätsmanagement und Interne Revision.

Voraussetzungen:

In diesem Seminar werden keine Vorkenntnisse vorausgesetzt.

Sonstiges:

Dauer: 2 Tage

Preis: 1790 Euro plus Mwst.

Ziele:

Lernen Sie im Seminar **RC136 Risikoaggregation in der Praxis** praxiserprobte Werkzeuge und Methoden zur Aggregation von Risiken sowie zum Aufbau eines Risikotragfähigkeitskonzepts kennen. Der Workshop basiert auf verschiedenen Fallstudien und bietet einen effizienten und gut strukturierten Einstieg in das Thema.

Inhalte/Agenda:

- ♦ **Betriebswirtschaftliche und rechtliche Impulse zur Risikoaggregation**
- ♦ **Forderung zur Risikoaggregation im neuen IDW PS 340**
- ♦ **Anforderungen resultierend aus dem DIIR Revisionsstandard Nr. 2: Prüfung des Risikomanagementsystems durch die Interne Revision**
- ♦ **Quantitative Beschreibung von Risiken**
- ♦ **Entwicklung eines Risikotragfähigkeitskonzepts, Ermittlung Risikodeckungspotenzial in der Praxis**
- ♦ **Wichtige Verteilungsfunktionen in der Praxis**
- ♦ **Entwicklung eines Prototypen zur Risikoaggregation**
- ♦ **Varianz-Kovarianz-Ansatzes versus stochastische Simulation**
- ♦ **Berücksichtigung von Abhängigkeiten bei der Modellierung**
- ♦ **Relevante Risiko- und Performancemaße in der Praxis (VaR, ES, RORAC/RAROC etc.)**
- ♦ **Sensitivitätsanalyse zur Priorisierung von Maßnahmen inkl. Maßnahmensimulation**
- ♦ **Praxisbeispiele aus Industrie und Handel**
- ♦ **Überblick Softwarelösungen**
- ♦