RC116 Quantitative Methoden im Risikomanagement

Kurzbeschreibung:

Das Seminar **RC116 Quantitative Methoden im Risikomanagement** 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. In diesem Seminar erlernen Sie klassische Value-at-Risk-Ansätze ebenso wie moderne stochastische Simulationsverfahren (inkl. Stochastische Prozesse). Zur integrierten Betrachtung von Risiken und Chancen werden praxistaugliche Risiko-Kennzahlen sowie Visualisierungen vorgestellt und diskutiert. Das Intensiv-Seminar bietet damit eine 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:

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 Exel und R (eigenes Notebook mit Excel-Installation sinnvoll)