RC136 Risikoaggregation in der Praxis

Kurzbeschreibung:

Risikoquantifizierung und Risikoaggregation (Risikosimulation) sind wesentlich für Controlling, Risikomanagement sowie die Unternehmens-, Strategie- und Investitionsbewertung. Bestandsgefährdende Entwicklungen können auch aus dem Zusammenwirken mehrerer Risiken resultieren, die bei isolierter Betrachtung an sich nicht bestandsgefährdend sind. Bei der Beurteilung, ob eine bestandsgefährdende Entwicklung vorliegt, ist daher eine Aggregation der Risiken erforderlich.

Im Praxis-Seminar **RC136 Risikoaggregation in der Praxis** werden fundierte Methoden zur Aggregation von Risiken vorgestellt und anhand von „Case Studies“ angewendet. Außerdem wird ein praxisorientierter Ansatz zur Entwicklung eines Risikotragfähigkeitskonzepts vorgestellt, um u.a. auch die Anforderungen aus dem Prüfungsstandard 340 (IDW PS 340) sowie dem DIIR Revisionsstandard Nr. 2 (Prüfung des Risikomanagementsystems durch die Interne Revision) zu erfüllen.

Alle Teilnehmer erhalten eine umfangreiche Dokumentation in gedruckter und elektronischer Form (USB-Stick). **Außerdem erhalten alle Teilnehmer das Buch "Erfolgsfaktor Risiko-Management 4.0 - Praxishandbuch für Industrie und Handel" (Romeike/Hager, 4. Auflage, Springer Verlag 2020)** 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**
- ♦