

RiskManager/-in (Univ.)

Zertifikatskurs der Universität Augsburg / ZWW

Kursübersicht

Start: 04. März 2021

Übersicht Kursverlaufsplan

Termin	Wochentag	Uhrzeit	Lehreinheit	Dozent
04.03.2021	Donnerstag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 1	Prof. Dr. Thomas Berger
05.03.2021	Freitag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 2	Prof. Dr. Thomas Berger
06.03.2021	Samstag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 3	Prof. Dr. Christian Klein
26.03.2021	Freitag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 4	Prof. Dr. Christian Klein
27.03.2021	Samstag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 5	Prof. Dr. Christian Klein
23.04.2021	Freitag	09:00 – 11:00	Lehreinheit 6	Dr. Tobias Gaugler
		11:15 – 13:15	Lehreinheit 6	Thomas Fritzsche
		14:15 – 18:00	Lehreinheit 7	Dr. Marc Wagner
24.04.2021	Samstag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 8	Prof. Dr. Thomas Berndt
07.05.2021	Freitag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 11	Dr. Niklas Lampenius
08.05.2021	Samstag	09:00 – 12:30	Lehreinheit 6	Asmus Carstensen
		13:30 – 17:00	Lehreinheit 6	Prof. Dr. Thomas Berger
		17:00 – 18:00	Fallstudie	Prof. Dr. Thomas Berger
14.05.2021	Freitag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 10	Dr. Oliver Sahan
15.05.2021	Samstag	09:00 – 18:00	Lehreinheit 9	Prof. Dr. Stefan Stöckl
26.06.2021	Samstag	09:00 – 11:30	Prüfung	Schriftliche Abschlussprüfung
		13:00 – 15:30	Fallstudie	Abschlusspräsentation

Einführungslehreinheit

Lehrskript zum Thema Risikomanagement zum Selbststudium

"Grundlagen des Risikomanagements" von Prof. Dr. Thomas Berger, Prof. Dr. Werner Gleißner

Lehreinheit 1

Rechtlicher Rahmen, Organisation und psychologische Aspekte

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Termin: 04. März 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Wesentliche, rechtliche und aufsichtsrechtliche Regelungen des Risikomanagements und der Corporate Governance
- Angrenzende rechtliche Anforderungen des Risikomanagements
- Aufbau und Organisation eines effektiven Risikomanagements
- Psychologische Aspekte

Lehreinheit 2

Risikoanalyse: Identifikation und Bewertung von Risiken

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Termin: 05. März 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Systematische Identifizierung aller auf ein Unternehmen einwirkender Einzelrisiken
- Bewertung der Risiken hinsichtlich ihrer Eintrittswahrscheinlichkeiten und ihrer quantitativen Auswirkungen
- Grundlagen der Risikoaggregation

Lehreinheit 3

Theoretische Grundlagen des Risikomanagements

Dozent: Prof. Dr. Christian Klein, Universität Kassel
Termin: 06. März 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Theoretische Grundlagen
- Statistische Grundlagen
- Wahrscheinlichkeitstheorie
- Entscheidungstheoretische Grundlagen
- Kapitalmarkttheoretische Grundlagen
- Exkurs: psychologische Faktoren auf Kapitalmärkten

Lehreinheit 4

Messverfahren im Risikomanagement

Dozent: Prof. Dr. Christian Klein, Universität Kassel

Termin: 26. März 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Vertiefung der Grundlagen der Entscheidungstheorie
- Betrachtung des Verhältnisses von Rendite und Risiko
- Vermittlung von traditionellen und risikoadjustierten Performancemessungen
- Exkurs: psychologische Aspekte bei der Risikowahrnehmung

Lehreinheit 5

Financial Risk Management

Dozent: Prof. Dr. Christian Klein, Universität Kassel

Termin: 27. März 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Risikomanagement als zentrale Funktion zur Shareholder Value Optimierung
- Fixed-Income Risiken, Währungsrisiken, Aktienrisiken, Kreditrisiken

Lehreinheit 6

Unternehmensrisiken

Dozent: Dr. Tobias Gaugler, Universität Augsburg

Thema: Rohstoffrisiken

Termin: 23. April 2021, 09.00 – 11.00 Uhr

- Einblick in verschiedene Formen von Cybersecurity-Vorfällen in Unternehmen
- Darstellung von forensischen Reaktionsmechanismen bei Cybersecurity-Vorfällen
- Veranschaulichung von Kostenspektren für die forensische Vorfallsbehandlung
- Einordnung in die Total Cost of Risk

Dozent: Thomas Fritzsche, Deloitte GmbH

Thema: IT-/Cyber-Risiken

Termin: 23. April 2021, 11.15 – 13.15 Uhr

- Grundlagen des Rohstoffrisikomanagements
- Identifikation und Messung von Rohstoffpreisisiken
- Hedging auf Rohstoffmärkten

Dozent: Asmus Carstensen, Daimler AG
Thema: Lieferantenrisikomanagement
Termin: 08. Mai 2021, 09.00 – 12.30 Uhr

- Risikomanagement im Bereich der Lieferanten
- Identifizierung und Bewertung kritischer Lieferanten
- Risikobewältigungsmaßnahmen

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Thema: Personalrisikomanagement
Termin: 08. Mai 2021, 13.30 – 17.00 Uhr

- Gemeinsamkeiten und Unterschiede zur Analyse und Bewertung von betrieblichen Risikomanagement
- Darstellung von Instrumenten und Verfahren zur Analyse und Bewertungen der Personalrisiken

Lehreinheit 7

Risikobewältigung und Versicherungen, Total Cost of Risk

Dozent: Dr. Marc Wagner, Oliver Wyman
Termin: 23. April 2021, 14.15 – 18.00 Uhr

- Erlernen der originären Aufgaben eines Risikomanagers – Bewältigung von Risiken
- Einschätzen möglicher Risikobewältigungsmaßnahmen
- Darstellung verschiedener Risikokosten im Rahmen des Total Cost of Risk-Ansatzes

Lehreinheit 8

Corporate Governance beim Risikomanagement

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berndt, Universität St. Gallen
Termin: 24. April 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Überblick über den gesamten Bereich der Corporate Governance
- Mechanismen der Corporate Governance
- Analyse der Mechanismen im Kontext von Unsicherheit und Risiko bei unternehmerischen Entscheidungen

Lehreinheit 9

Spezielle Anwendungsfelder (Rating-Strategien, Finanzierung, Sanierungen)

Dozent: Prof. Dr. Stefan Stöckl, ICN Business School

Termin: 15. Mai 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Darstellung verschiedener Schnittstellen von z.B. Rating und Risikomanagement
- Erläuterung der Methodik für die Erstellung von Rating-Prognosen

Lehreinheit 10

Compliance

Dozent: Dr. Oliver Sahan, Roxin Rechtsanwälte

Termin: 14. Mai 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

- Compliance – Begriff und Abgrenzung
- Verhältnis von Compliance und Risikomanagement
- Praktische Bedeutung von Compliance für den RiskManager / die RiskManagerin
- Regulatorische Risiken im Unternehmen
- Risikominimierung durch Criminal Compliance
- Risikoanalyse
- Vergangenheitsbezogene und zukunftsorientierte Compliance Maßnahmen

Lehreinheit 11

Risikoaggregation mit Simulationssoftware

Dozent: Dr. Niklas Lampenius, Universität Hohenheim

Termin: 07. Mai 2021, 09.00 – 18.00 Uhr

Hinweis:

Hierzu wird auf die Simulationssoftware @RISK von Palisade, die als Excel Add-in fungiert, zurückgegriffen, um eine einfache und praxisnahe Umsetzung einer Monte-Carlo-Simulation in der gewohnten Excel Umgebung zu ermöglichen. Für diese Lehreinheit benötigen die Teilnehmer einen Laptop mit Excel von MS Office.

Fallstudie

Praktische Umsetzung des Risk Managements: Fallstudie „KMU GmbH“

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Termin: 08. Mai 2021, 17.00 – 18.00 Uhr

- Einführung in die Fallstudie
- Einteilung in Teams zur Fallstudienbearbeitung

Hinweis:

In Kleingruppen wird das fiktive Unternehmen „Die Augsburgische Plastik GmbH“ analysiert. Im operativen Teil sollen die Unternehmensrisiken identifiziert und bewertet sowie Risikobewältigungsstrategien elaboriert werden. Im strategischen Teil sollen die strategische Ausrichtung des Unternehmens analysiert und Verbesserungsmöglichkeiten erarbeitet werden.

Prüfung

Schriftliche Abschlussprüfung: 26. Juni 2021 (09:00-11:30)
Präsentation der Fallstudie: 26. Juni 2021 (13:00-15:30)