

Risk Manager/-in (Univ.)

Zertifikatskurs der Universität Augsburg / ZWW

Kursübersicht

Start: 15. September 2023

Übersicht Kursverlaufsplan

Termin	Wochentag	Uhrzeit	Lehreinheit	Dozent
15.09.2023	Freitag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 1	Prof. Dr. Thomas Berger
16.09.2023	Samstag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 2	Prof. Dr. Thomas Berger
28.09.2023	Donnerstag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 3	Prof. Dr. Christian Klein
29.09.2023	Freitag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 4	Prof. Dr. Christian Klein
30.09.2023	Samstag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 5	Michael Klein
20.10.2023	Freitag	09.00 – 11.00	Lehreinheit 6	Dr. Markus Ulze
		11.15 – 13.15	Lehreinheit 6	Thomas Fritzsche
		14.15 – 17.00	Lehreinheit 6	Prof. Dr. Thomas Berger
21.10.2023	Samstag	09.00 – 12.30	Lehreinheit 6	Asmus Carstensen
		13.30 – 17.15	Lehreinheit 7	Dr. Marc Wagner
27.10.2023	Freitag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 8	Dr. Stefan Stöckl
28.10.2023	Samstag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 9	Prof. Dr. Thomas Berndt
10.11.2023	Freitag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 10	Michael Reinhart
11.11.2023	Samstag	09.00 – 18.00	Lehreinheit 11	Dr. Niklas Lampenius
01.12.2023	Freitag	09.00 – 11.30	Prüfung	Schriftliche Abschlussprüfung
		13.30 – 15.00	Prüfung	Abschlusspräsentation

Zusätzlich einzuplanender Termin:

Prof. Dr. Thomas Berger wird in Abstimmung mit den Teilnehmenden einen weiteren Online-Termin von etwa einer Stunde für die praktische Umsetzung des Risikomanagements (Fallstudie) anbieten.

Lehreinheit 1

Rechtlicher Rahmen, Organisation und psychologische Aspekte

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Termin: 15. September 2023, 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: 16. September 2023, 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: 28. September 2023, 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: 29. September 2023, 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: Michael Klein

Termin: 30. September 2023, 09.00 – 18.00 Uhr

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

Lehreinheit 6

Unternehmensrisiken

Dozent: Dr. Markus Ulze, Universität Augsburg

Thema: Rohstoffrisiken

Termin: 20. Oktober 2023, 09.00 – 11.00 Uhr

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

Dozent: Thomas Fritzsche, Deloitte GmbH

Thema: IT-/Cyber-Risiken

Termin: 20. Oktober 2023, 11.15 – 13.15 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: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Thema: Personalrisikomanagement
Termin: 20. Oktober 2023, 14.15 – 17.00 Uhr

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

Dozent: Asmus Carstensen, Daimler AG
Thema: Lieferantenrisikomanagement
Termin: 21. Oktober 2023, 09.00 – 12.30 Uhr

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

Lehreinheit 7

Risikobewältigung und Versicherungen, Total Cost of Risk

Dozent: Dr. Marc Wagner, JPMorgan Chase & Co.
Termin: 21. Oktober 2023, 13.30 – 17.15 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

Spezielle Anwendungsfelder (Rating-Strategien, Finanzierung, Sanierungen)

Dozent: Dr. Stefan Stöckl, IDEA Beratungs- und Forschungsgesellschaft mbH
Termin: 27. Oktober 2023, 09.00 – 18.00 Uhr

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

Lehreinheit 9

Corporate Governance beim Risikomanagement

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berndt, Universität St. Gallen

Termin: 28. Oktober 2023, 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 10

Compliance

Dozent: Michael Reinhart, Rechtsanwalt

Termin: 10. November 2023, 09.00 – 18.00 Uhr

- Compliance – Begriff und Abgrenzung
- Verhältnis von Compliance und Risikomanagement
- Praktische Bedeutung von Compliance für den Risk Manager / die Risk Managerin
- 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: 11. November 2023, 09.00 – 18.00 Uhr

Hinweis:

Hierzu wird auf die Simulationssoftware @RISK von Lumivero (ehemals Palisade), die als Excel Add-in angelegt ist, 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 und entsprechende Admin-Rechte, um die Simulationssoftware installieren zu können.

Fallstudie

Praktische Umsetzung des Risk Managements: Fallstudie „KMU GmbH“

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart
Termin: flexibler Termin von ca. einer Stunde in Abstimmung mit den Teilnehmenden

- Einführung in die Fallstudie
- Einteilung in Teams zur Fallstudienbearbeitung

Hinweis:

In Kleingruppen wird das fiktive Unternehmen „KMU 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: 1. Dezember 2023

Präsentation der Fallstudie: 1. Dezember 2023