

# Seminarangebot

## Risikomanagement in der Unternehmenssteuerung

In der jüngsten Finanz- und Wirtschaftskrise ist es trotz des Einsatzes hochkomplexer quantitativer Instrumentarien des modernen Risikocontrollings kaum gelungen, Risiken adäquat einzuschätzen und rechtzeitig geeignete Maßnahmen einzuleiten. Die Grenzen quantitativer Risikomanagementkonzepte sind damit offenbar geworden. Vor allem aber wurde deutlich, wie unzulänglich noch immer die einzelnen Risikomanagementeinheiten in die Unternehmenssteuerungsprozesse eingebunden sind. Neben der Verbesserung der Modelle gehört daher die Verzahnung mit der strategischen Unternehmensführung sowie den verschiedenen betrieblichen Planungs-, Kontroll- und Reportingfunktionen zu den zentralen Herausforderungen. Dies spiegelt sich auch in den aktuellen regulatorischen Verschärfungen der Anforderungen z.B. in den MaRisk wider.

### Seminarziele

Ziel des Seminars ist es, den Teilnehmern ein tiefergehendes Verständnis der Bedeutung und aktuellen Herausforderungen des Risikomanagements für die Bank- und Unternehmenssteuerung zu vermitteln und aufzuzeigen, wie die Aufgaben im Zusammenspiel der verschiedenen Unternehmensfunktionen bewältigt werden können. Dies geschieht unter Einbeziehung der wichtigsten regulatorischen Vorgaben. Die eingehende Auseinandersetzung mit den Grundlagen quantitativer Messverfahren für verschiedene Risikoarten soll die Teilnehmer in die Lage versetzen, Nutzen und Grenzen dieser Risikomanagementkonzepte zu erkennen und die gewonnenen Informationen und Kenntnisse zielführend einzusetzen.

Anhand verschiedener Fallbeispiele, die die Teilnehmer in Gruppenarbeiten diskutieren, werden die Schnittstellen des Risikomanagements zu den anderen Steuerungsbereichen von Banken und Unternehmen aufgezeigt. Damit sollen neue Sichtweisen und Handlungsperspektiven eröffnet werden.

### Programm

- Risikomanagement und wertorientierte Unternehmensführung
- Aufsichtsrechtliche Anforderungen an das Risikomanagement (Basel II und III, Solvency II, MaRisk, DerivateV, MaComp)

- Identifikation von Risiken
- Grundlagen der Risikomessung: Wahrscheinlichkeitsverteilungen, Risikomaße und Worst-Case-Risiko
- Funktionsweisen und Grenzen quantitativer Risikomessverfahren: Marktrisiko, Kreditrisiko, Operationales Risiko und Liquiditätsrisiko
- Prozess und Organisation des Risikomanagements
- Fallstudie in Gruppenarbeit: Risikoberichte und Unternehmensentscheidungen
- Fallstudie in Gruppenarbeit: Controlling und Risikomanagement
- Fallstudie: Risikomanagement und Unternehmensstrategie
- Ausblick: Zukünftige Rolle des Risikomanagements in der Unternehmenssteuerung

### Methoden

Vortrag, Diskussion, Erfahrungsaustausch, Fallbeispiele, Gruppenarbeiten

#### Zielgruppen

Fach- und Führungskräfte von Banken, Unternehmen und Kapitalanlagegesellschaften in den Bereichen Treasury, Risikomanagement und -controlling sowie Strategie; Unternehmensberater und Wirtschaftsprüfer

#### Voraussetzungen

Studium oder äquivalente Ausbildung in einem fachnahen Bereich, mehrjährige berufliche Erfahrung

#### Dozenten

Prof. Dr. Lutz Johanning (WHU - Otto Beisheim School of Management)  
Dr. Ralf Kauther  
Tim Uhle (Goethe-Universität Frankfurt)

#### Veranstaltungsort

Frankfurt am Main

#### Dauer

31.05. - 01.06.2012 (2 Tage)

#### Max. Teilnehmerzahl

20 Personen

#### Teilnahmegebühr

1.450,00 EUR  
(zzgl. gesetzlicher MwSt.)

Dieses Seminar ist auch als In-House Veranstaltung buchbar.

#### Kontakt:

EDA  
vwd academy AG  
Bettinastraße 59  
60325 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 768075-20  
Telefax: +49 69 768075-19  
E-Mail: mail@ed-academy.com  
Web: ed-academy.com