

## Risk Manager/-in (Univ.)

Zertifikatskurs der Universität Augsburg / ZWW

Kursübersicht

Start: 13. September 2024

## Übersicht Kursverlaufsplan

| Termin            | Wochentag  | Uhrzeit       | Format              | Dozent                           |
|-------------------|------------|---------------|---------------------|----------------------------------|
| <b>13.09.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 1: Präsenz  | Prof. Dr. Thomas Berger          |
| <b>14.09.2024</b> | Samstag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 2: Präsenz  | Prof. Dr. Thomas Berger          |
| <b>26.09.2024</b> | Donnerstag | 09.00 – 18.00 | Einheit 3: online   | Prof. Dr. Christian Klein        |
| <b>27.09.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 4: online   | Prof. Dr. Christian Klein        |
| <b>28.09.2024</b> | Samstag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 5: online   | Michael Klein                    |
| <b>18.10.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 11.00 | Einheit 6: online   | Dr. Marcus Ulze                  |
|                   |            | 11.15 – 13.15 | Einheit 6: online   | Thomas Fritzsche                 |
|                   |            | 14.15 – 17.15 | Einheit 6: online   | Prof. Dr. Thomas Berger          |
|                   |            | 17.30 – 18.00 | Fallstudie: online  | Prof. Dr. Thomas Berger          |
| <b>19.10.2024</b> | Samstag    | 09.00 – 12.30 | Einheit 6: online   | Asmus Carstensen                 |
|                   |            | 13.30 – 18.00 | Einheit 7: online   | Dr. Marc Wagner                  |
| <b>25.10.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 8: online   | Dr. Stefan Stöckl                |
| <b>26.10.2024</b> | Samstag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 9: online   | Prof. Dr. Thomas Berndt          |
| <b>08.11.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 10: Präsenz | Michael Reinhart                 |
| <b>09.11.2024</b> | Samstag    | 09.00 – 18.00 | Einheit 11: Präsenz | Dr. Niklas Lampenius             |
| <b>29.11.2024</b> | Freitag    | 09.00 – 11.30 | Prüfung: online     | Schriftliche<br>Abschlussprüfung |
|                   |            | 13.30 – 17.00 | Fallstudie: online  | 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 und offene Fragen beantworten.

## Lehreinheit 1

### Rechtlicher Rahmen, Organisation und psychologische Aspekte

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart  
Termin: 13. September 2024, 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: 14. September 2024, 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: 26. September 2024, 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: 27. September 2024, 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, Dozent für Wirtschaftsmathematik, Finanzierung, Statistik

Termin: 28. September 2024, 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, Partner & Financial Engineer AGEROS GmbH

Thema: Rohstoffrisiken

Termin: 18. Oktober 2024, 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: 18. Oktober 2024, 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: 18. Oktober 2024, 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: 19. Oktober 2024, 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  
Termin: 19. Oktober 2024, 13.30 – 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

##### Spezielle Anwendungsfelder (Rating-Strategien, Finanzierung, Sanierungen)

Dozent: Dr. Stefan Stöckl, IDEA Beratungs- und Forschungsgesellschaft mbH  
Termin: 25. Oktober 2024, 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: 26. Oktober 2024, 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: 8. November 2024, 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: 9. November 2024, 09.00 – 18.00 Uhr

Hinweis:

Hierzu wird auf die Simulationssoftware @RISK von Lumivero, 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. Mac-Geräte mit Excel für Mac werden leider nicht unterstützt.

## Fallstudie

### Praktische Umsetzung des Risk Managements: Fallstudie

Dozent: Prof. Dr. Thomas Berger, Duale Hochschule Baden-Württemberg Stuttgart

Termin: 18. Oktober 2024, 17.00 – 18.00 Uhr

- Einführung in Fallstudie
- Einteilung in Teams zur Fallstudienbearbeitung

#### Hinweis:

In Kleingruppen wird ein fiktives Unternehmen analysiert. Im operativen Teil sollen die Unternehmensrisiken identifiziert und bewertet sowie Risikobewältigungsstrategien elaboriert werden. Im strategischen Teil wird die strategische Ausrichtung des Unternehmens analysiert und Verbesserungsmöglichkeiten erarbeitet.

## Prüfung

Schriftliche Abschlussprüfung: 29. November 2024

Präsentation der Fallstudie: 29. November 2024