

GRUNDLAGEN DER SIMULATIONSBASIERTEN RISIKOAGGREGATION MIT EXCEL – MIT FALLBEISPIEL UND PRAXISEMPFEHLUNGEN (ONLINE-SEMINAR)

In diesem halbtägigen Online-Seminar wird an einem einfachen Praxisbeispiel erläutert, wie mit Hilfe von MS-Excel und dem Add-In Crystal Ball simulationsbasierte Risikoaggregationsmodelle entwickelt und die Ergebnisse der Simulation interpretiert werden können. Das Seminar wird von der RMA Rating & Risk Academy GmbH in Kooperation mit der FutureValue Group AG durchgeführt.

ZIELGRUPPE

Fach- und Führungskräfte in Unternehmen mit Schwerpunkt Risikomanagement, Controlling, Planung, Unternehmensentwicklung/-steuerung und Interne Revision, Wirtschaftsprüfer, Unternehmensberater.

ZIELSETZUNG DES SEMINARS

Nach dem Seminar kennen Sie die grundlegenden Techniken, um mit Hilfe von MS-Excel und dem Add-In Crystal Ball simulationsbasierte Risikoaggregationsmodelle zu entwickeln und die Ergebnisse der Simulation zu interpretieren.

SEMINARBESCHREIBUNG

Gesetzliche Kernanforderung, vor allem aber ökonomische Notwendigkeit ist es, den Gesamtrisikoumfang eines Unternehmens zu bestimmen. Nur so kann beurteilt werden, ob die Risikotragfähigkeit eines Unternehmens ausreichend ist, um risikobedingt mögliche Verluste zu tragen und damit den Bestand des Unternehmens auch langfristig zu gewährleisten, und ob Ertrag und Risiko in einem ausgewogenen Verhältnis stehen. Das aggregierte Ertragsrisiko kann in praktischen Anwendungsfällen sachgerecht nur mit Hilfe einer stochastischen Szenariotechnik (Monte-Carlo-Simulation) bestimmt werden.

Im Rahmen des Seminars werden die Grundlagen einer szenarioorientierten Planung dargestellt. Es wird an einem einfachen Praxisbeispiel erläutert, wie mit Hilfe von MS-Excel und dem Add-In Crystal Ball simulationsbasierte Risikoaggregationsmodelle entwickelt und die Ergebnisse der Simulation interpretiert werden können.

INHALT

- Grundlagen zur Bestimmung des Gesamtrisikoumfangs
 - Identifikation und quantitative Beurteilung von Risiken mittels adäquaten Wahrscheinlichkeitsverteilungen
 - Monte-Carlo-Simulation im Überblick
 - Ergebnisse einer Monte-Carlo-Simulation und deren Interpretation
- Einfaches Fallbeispiel in MS-Excel mit Crystal Ball
 - Überführung einer einwertigen in eine stochastische Planung
 - Modellierung wesentlicher Risiken (Anlegen von Verteilungen)
 - Anlegen von Zielgrößen
 - Umsetzungsempfehlungen für die Praxis

REFERENTEN

Marco Wolfrum

Partner FutureValue Group AG und Vorstand RMA Risk Management & Rating Association e.V.

Marco Wolfrum leitet als Partner bei der FutureValue Group AG den Bereich Leistungserstellung und übt die Leitung in einer Vielzahl von Projekten aus. Seit September 2014 ist er Mitglied des Vorstands der RMA Risk Management & Rating Association e.V. Herr Wolfrum ist zudem Autor zahlreicher Fachveröffentlichungen nimmt Lehraufträge an diversen Hochschulen dar und ist Referent bei diversen Seminaranbietern. Einer seiner Beratungsschwerpunkte liegt im Aufbau und der Weiterentwicklung von (stochastischen) Financial Models - insbesondere in Excel (in Verbindung mit Add-Ins zur Durchführung von Simulationen wie Crystal Ball).

TERMINE UND ORT

Das Seminar findet online statt (auf Anfrage vor Ort)

23. Juni 2021, 13:00 bis 16:30 Uhr

19. Oktober 2021, 9:30 Uhr bis 13:00 Uhr

Wählen Sie einen Termin – beschränkte Teilnehmerzahl.

TEILNAHMEGEBÜHR

Preis pro Teilnehmer (jeweils zzgl. gesetzlich gültiger MWSt.)

- 500 € für RMA-Mitglieder
- 550 € für Nicht-RMA-Mitglieder

TEILNAHMEBEDINGUNGEN / ORGANISATORISCHE HINWEISE

Nach Eingang Ihrer Anmeldung erhalten Sie eine Anmeldebestätigung per E-Mail. Ihren persönlichen Zugangslink für das Live Online-Seminar erhalten Sie spätestens einen Tag vor der Veranstaltung.

Ein schriftlicher Rücktritt ist 14 Tage vor Veranstaltungsbeginn kostenfrei möglich. Bei schriftlicher Stornierung nach Versand der Zugangsdaten wird eine Bearbeitungsgebühr in Höhe von 50% der jeweiligen Teilnahmegebühr fällig. Nach Beginn des Online-Seminars und dem Einloggen des Teilnehmers in das Online-Seminar ist kein Rücktritt mehr möglich bzw. der volle Betrag wird fällig.

Die Benennung eines Ersatzteilnehmers (mit Vornamen, Nachnamen und E-Mail-Adresse) ist bis einen Tag vor Beginn des Online-Seminars möglich. Wird die Veranstaltung storniert, werden bereits gezahlte Teilnahmegebühren rückerstattet. Weitere Ansprüche bestehen nicht.

Die uns mitgeteilten personenbezogenen Daten werden mittels elektronischer Datenverarbeitung unter Beachtung des Datenschutzgesetzes zum Zwecke der Vertragsabwicklung gespeichert und verwendet. Weitere Informationen zum Datenschutz können den Datenschutzerklärungen der RMA und der FutureValue Group AG entnommen werden.

ANMELDUNG

Hiermit melde ich mich verbindlich an für das Seminar

Grundlagen der simulationsbasierten Risikoaggregation mit Excel – mit Fallbeispiel und Praxisempfehlungen (Online-Seminar)

am

23. Juni 2021, 13:00 bis 16:30 Uhr
19. Oktober 2021, 9:30 Uhr bis 13:00 Uhr

Vorname *	
Nachname *	
Anrede / Titel / Berufsbezeichnung	
Firma	
Straße/Hausnummer *	
PLZ Ort *	
Telefon *	
E-Mail *	
Vollständige Rechnungsanschrift (ggf. Bestellnummer, weitere Angaben) / USt-ID (von Unternehmen mit Sitz in der EU außerhalb Deutschlands)	
Mitglied der RMA *	<input type="radio"/> ja <input type="radio"/> nein

- Ja, ich möchte per E-Mail über weitere Veranstaltungen sowie fachliche Neuigkeiten der RMA Risk Management & Rating Association e.V., der Rating & Risk Academy GmbH und der FutureValue Group AG informiert werden. Die Newsletter können jederzeit abbestellt werden.
- Ich akzeptiere die die o.g. Teilnahmebedingungen und melde mich verbindlich an

Ort, Datum, Unterschrift

Bitte senden Sie die ausgefüllte Anmeldung per E-Mail an: info@rma-academy.org