

Quantitatives Risikomanagement (Präsenz)

Bewertung von Risiken und Ermittlung des Gesamtrisikos

Für die Bewertung von Risiken stehen im Risikomanagement zahlreiche Instrumente und Methoden zur Verfügung. Dies reicht von einfachen Ansätzen wie der Risk Map bis zu komplexen, auf der Wahrscheinlichkeitsrechnung basierenden Verfahren. Eine richtige Bewertung der Risiken und von deren Auswirkungen auf den Unternehmenserfolg liefert die Basis für eine proaktive Steuerung der Risiken. Lerne die Bandbreite der unterschiedlichen Verfahren und Modelle im Bereich des quantitativen Risikomanagements kennen und erfahre, wie du diese nutzen kannst.

Inhalte

Quantitative und qualitative Risiken

- Definitionen.
- Abgrenzung.
- Nominal-skalierte, ordinal-skalierte und metrisch-skalierte Risiken.

Modellierung und Bewertung quantitativer Risiken

- Risk Map: Eintrittswahrscheinlichkeit und Schadensausmaß.
- Wahrscheinlichkeitsverteilungen und Kennzahlen.
- Spezielle Wahrscheinlichkeitsverteilungen im Risikomanagement.
- Risikokennzahlen: Value at Risk und Expected Shortfall.
- Simulation von Risiken (mit Excel).

Modellierung und Bewertung qualitativer Risiken

- Risk Map: Bedeutungsgrad und Ausprägungsform.
- Risiko-Ranking.

Abhängigkeiten von Risiken

- Bedingte Wahrscheinlichkeiten.
- Korrelationen.
- Copulas.

Gesamtrisikoumfang

- Gesamtbrutto- und Gesamtnettorisiko.
- Varianz-Kovarianz-Analyse.
- Monte-Carlo-Simulation.
- EDV-technische Umsetzung.

Lernumgebung

In deiner Online-Lernumgebung findest du nach deiner Anmeldung nützliche Informationen, Downloads und Extra-Services zu dieser Qualifizierungsmaßnahme.

Dein Nutzen

Du lernst die Bandbreite der im quantitativen Risikomanagement verwendeten Modelle und Methoden kennen. Du erhältst einen umfassenden Gesamtüberblick:

- über die unterschiedlichen Modelle für quantitative Risiken und wie diese von der Modellierung qualitativer Risiken abzugrenzen sind,
- darüber, welche Bewertungsverfahren es für quantitative Risiken gibt,
- wie Abhängigkeiten von Risiken bei den Modellen und Verfahren berücksichtigt werden,

- welche Möglichkeiten es gibt, ein Gesamtrisiko zu ermitteln,
- wie die Verfahren in EDV-Lösungen umgesetzt werden und
- welche Entwicklungstrends sich im quantitativen Risikomanagement abzeichnen.

Methoden

Praxisorientierter Vortrag, Beispiele, Diskussion, Fallstudien, Übungen.

Teilnehmer:innenkreis

Risikomanager:innen, Risikocontroller:innen, Fach- und Führungskräfte aus dem Controlling, den verschiedensten risikorelevanten Unternehmensbereichen und der internen Revision, die ihre Risikomanagementkenntnisse vertiefen möchten. Grundkenntnisse aus dem Bereich Wahrscheinlichkeitsrechnung sind erforderlich, z. B. durch Teilnahme am Seminar „Risikomanagement kompakt“.

Open Badges - Zeige auch digital, was du kannst.

Open Badges sind anerkannte, digitale Teilnahmezertifikate. Diese verifizierbaren Nachweise sind der aktuelle Standard für die Einbindung in Karrierenetzwerken wie z.B. LinkedIn.

Damit zeigst du digital, über welche Kompetenzen du verfügst.

Nach erfolgreichem Abschluss erhältst du von uns ein Open Badge.

Mehr erfahren kannst du unter:

<https://www.haufe-akademie.de/seminare-lehrgaenge/trending-topics/open-badges>



Referent:in



Prof. Dr. Ralf Knobloch

Die Verbindung von Theorie und Praxis in den Wirtschaftswissenschaften ist mir eine Herzensangelegenheit. Dabei kommt es auf den richtigen Mittelweg an. Es ist mir immer eine Freude, wenn ein Praxisproblem mithilfe eines theoretischen Ansatzes gelöst werden kann. Diese Freude am Zusammenspiel von Theorie und Praxis versuche ich den Teilnehmenden meiner Veranstaltungen zu vermitteln.

Details zur Weiterbildung

2 Tage

Termine

08.-09.03.2027

München

Veranstaltungsort

Holiday Inn Unterhaching

Tage & Uhrzeit

Montag, 08.03.2027

09:30 Uhr - 17:30 Uhr

Dienstag, 09.03.2027

09:00 Uhr - 17:00 Uhr

Aktuelle Termine und weitere Informationen findest du unter www.haufe-akademie.de/30516

Teilnahmegebühr

€ 1.490,- zzgl. MwSt.

€ 1.773,10 inkl. MwSt.

Die angegebene Teilnahmegebühr beinhaltet

- ein gemeinsames Mittagessen pro vollem Seminartag,
- Pausenverpflegung und
- umfangreiche Arbeitsunterlagen.

Die Übernachtungskosten im Hotel werden von den Teilnehmenden direkt mit dem Hotel abgerechnet. Für die Hotelbuchung findest du in deiner Lernumgebung ein Reservierungsformular.

Deine Anmeldemöglichkeiten

Online: www.haufe-akademie.de/30516

E-Mail: anmelden@haufe-akademie.de

Buche deine Weiterbildung einfach und schnell online. Gib sonst bitte unbedingt den Namen des Teilnehmenden und die vollständige Rechnungsanschrift mit Telefonnummer sowie E-Mail-Adresse an.

In unserem Bereich Fragen & Antworten (FAQ) findest du alle Antworten auf die häufigsten Fragen rund um unsere Weiterbildungen:

<https://www.haufe-akademie.de/faqs>

Unsere ausführlichen Teilnahmebedingungen findest du auch im Internet unter www.haufe-akademie.de/agb oder im Gesamtprogramm.

Die vollständigen Datenschutzbestimmungen findest du unter www.haufe-akademie.de/datenschutz.

Quantitatives Risikomanagement (Live-Online)

Bewertung von Risiken und Ermittlung des Gesamtrisikos

Für die Bewertung von Risiken stehen im Risikomanagement zahlreiche Instrumente und Methoden zur Verfügung. Dies reicht von einfachen Ansätzen wie der Risk Map bis zu komplexen, auf der Wahrscheinlichkeitsrechnung basierenden Verfahren. Eine richtige Bewertung der Risiken und von deren Auswirkungen auf den Unternehmenserfolg liefert die Basis für eine proaktive Steuerung der Risiken. Lerne die Bandbreite der unterschiedlichen Verfahren und Modelle im Bereich des quantitativen Risikomanagements kennen und erfahre, wie du diese nutzen kannst.

Inhalte

Quantitative und qualitative Risiken

- Definitionen.
- Abgrenzung.
- Nominal-skalierte, ordinal-skalierte und metrisch-skalierte Risiken.

Modellierung und Bewertung quantitativer Risiken

- Risk Map: Eintrittswahrscheinlichkeit und Schadensausmaß.
- Wahrscheinlichkeitsverteilungen und Kennzahlen.
- Spezielle Wahrscheinlichkeitsverteilungen im Risikomanagement.
- Risikokennzahlen: Value at Risk und Expected Shortfall.
- Simulation von Risiken (mit Excel).

Modellierung und Bewertung qualitativer Risiken

- Risk Map: Bedeutungsgrad und Ausprägungsform.
- Risiko-Ranking.

Abhängigkeiten von Risiken

- Bedingte Wahrscheinlichkeiten.
- Korrelationen.
- Copulas.

Gesamtrisikoumfang

- Gesamtbrutto- und Gesamtnettorisiko.
- Varianz-Kovarianz-Analyse.
- Monte-Carlo-Simulation.
- EDV-technische Umsetzung.

Lernumgebung

In deiner Online-Lernumgebung findest du nach deiner Anmeldung nützliche Informationen, Downloads und Extra-Services zu dieser Qualifizierungsmaßnahme.

Dein Nutzen

Du lernst die Bandbreite der im quantitativen Risikomanagement verwendeten Modelle und Methoden kennen. Du erhältst einen umfassenden Gesamtüberblick:

- über die unterschiedlichen Modelle für quantitative Risiken und wie diese von der Modellierung qualitativer Risiken abzugrenzen sind,
- darüber, welche Bewertungsverfahren es für quantitative Risiken gibt,
- wie Abhängigkeiten von Risiken bei den Modellen und Verfahren berücksichtigt werden,

- welche Möglichkeiten es gibt, ein Gesamtrisiko zu ermitteln,
- wie die Verfahren in EDV-Lösungen umgesetzt werden und
- welche Entwicklungstrends sich im quantitativen Risikomanagement abzeichnen.

Methoden

Praxisorientierter Vortrag, Beispiele, Diskussion, Fallstudien, Übungen.

Teilnehmer:innenkreis

Risikomanager:innen, Risikocontroller:innen, Fach- und Führungskräfte aus dem Controlling, den verschiedensten risikorelevanten Unternehmensbereichen und der internen Revision, die ihre Risikomanagementkenntnisse vertiefen möchten. Grundkenntnisse aus dem Bereich Wahrscheinlichkeitsrechnung sind erforderlich, z. B. durch Teilnahme am Seminar „Risikomanagement kompakt“.

Open Badges - Zeige auch digital, was du kannst.

Open Badges sind anerkannte, digitale Teilnahmezertifikate. Diese verifizierbaren Nachweise sind der aktuelle Standard für die Einbindung in Karrierenetzwerken wie z.B. LinkedIn.

Damit zeigst du digital, über welche Kompetenzen du verfügst.

Nach erfolgreichem Abschluss erhältst du von uns ein Open Badge.

Mehr erfahren kannst du unter:

<https://www.haufe-akademie.de/seminare-lehrgaenge/trending-topics/open-badges>



Referent:in



Prof. Dr. Ralf Knobloch

Die Verbindung von Theorie und Praxis in den Wirtschaftswissenschaften ist mir eine Herzensangelegenheit. Dabei kommt es auf den richtigen Mittelweg an. Es ist mir immer eine Freude, wenn ein Praxisproblem mithilfe eines theoretischen Ansatzes gelöst werden kann. Diese Freude am Zusammenspiel von Theorie und Praxis versuche ich den Teilnehmenden meiner Veranstaltungen zu vermitteln.

Details zur Weiterbildung

Seminar | Online

2 Tage

Starttermine**19.-20.11.2026**

Live-Online

Durchführung

zoom

Modulzeiten

Donnerstag, 19.11.2026

09:30 Uhr - 17:30 Uhr

Freitag, 20.11.2026

09:00 Uhr - 17:00 Uhr

Aktuelle Termine und weitere Informationen findest du unter www.haufe-akademie.de/33001**Teilnahmegebühr****€ 1.490,- zzgl. MwSt.**

€ 1.773,10 inkl. MwSt.

Deine AnmeldemöglichkeitenOnline: www.haufe-akademie.de/30516E-Mail: anmelden@haufe-akademie.de

Buche deine Weiterbildung einfach und schnell online. Gib sonst bitte unbedingt den Namen des Teilnehmenden und die vollständige Rechnungsanschrift mit Telefonnummer sowie E-Mail-Adresse an.

In unserem Bereich Fragen & Antworten (FAQ) findest du alle Antworten auf die häufigsten Fragen rund um unsere Weiterbildungen:

<https://www.haufe-akademie.de/faqs>

Unsere ausführlichen Teilnahmebedingungen findest du auch im Internet unter www.haufe-akademie.de/agb oder im Gesamtprogramm.

Die vollständigen Datenschutzbestimmungen findest du unter www.haufe-akademie.de/datenschutz.