

Kurs: Risikomanagement

Dozent(in)	Prof. Dr. Patrick Dienes
Teilnahmevoraussetzungen	Formal: nein
	Inhaltlich: Wirtschaftsmathematik, Statistik, Finanz- und Investitionswirtschaft,
Prüfungsleistung	ELN auf Basis einer schriftlichen Klausur (60 Minuten)
Prüfungsvorleistung	Projekt-/Gruppenarbeit
Bewertung der Prüfungsleistung	endnotenbildend
Bestehenserblich	ja
Qualifikationsziele / Lernergebnisse	<p>Die Studierenden erwerben Kenntnisse im Management und Controlling von Risiken, insbesondere von Finanzrisiken.</p> <p>Die Veranstaltung setzt dabei folgende Schwerpunkte:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Risikomanagementprozess • Quantitative Risikobewertung • Risikosteuerung mittels Finanzinstrumenten • Risikocontrolling <p>Die Studierenden sollen somit nach Abschluss des Seminars Kenntnisse in den Methoden und Instrumenten zur Identifikation, Bewertung, Steuerung und Kontrolle von Risiken erworben haben.</p> <p>Im Mittelpunkt der Risikobewertung stehen moderne Risikomaße, wie der „Value at Risk“. Die Studierenden sind in der Lage, betriebswirtschaftliche Risiken mit komplexen und modernen Methoden <u>quantitativ</u> zu bewerten. Darüber hinaus sind sie vertraut mit den wichtigsten Finanzinstrumenten zum Hedging von Finanzrisiken. Schließlich lernen sie wichtige, praxisorientierte Instrumente des Risikocontrollings kennen.</p> <p>Die Studierenden erarbeiten einen Teil der Inhalte selbst in Form einer Projekt-/Gruppenarbeit.</p> <p>Ziel ist die Vermittlung von 40 % Fachkompetenz, 30 % Methodenkompetenz und 30 % Sozialkompetenz.</p>

Inhalte	<ul style="list-style-type: none">• Grundbegriffe: Risiko, Risikomanagement und Risikocontrolling• Risikomanagementprozess• Risikoidentifikation• Quantitative Risikobewertung• Risikosteuerung (vor allem für Markt- bzw. Preisrisiken): Hedging mittels Finanzinstrumenten• Risikoüberwachung/-kontrolle
Medien	Beamer mit Laptop, Tafel, Flipchart
Literatur	<ul style="list-style-type: none">• Diederichs, Marc: Risikomanagement und Risikocontrolling, 3., vollständig überarbeitete Auflage, Vahlen, München 2012.• Gleißner, Werner: Grundlagen des Risikomanagements im Unternehmen. Controlling, Unternehmensstrategie und wertorientiertes Management, 2., komplett überarbeitete und erweiterte Auflage, Vahlen, München 2011.• Hull, John: Risikomanagement. Banken, Versicherungen und andere Finanzinstitutionen, 2., aktualisierte Auflage, Pearson, München 2011.• Schneck, Ottmar: Risikomanagement. Grundlagen, Instrumente, Fallbeispiele, Wiley-VCH, Weinheim, 2010.