

**Kurs: Risikomanagement**

<b>Dozent(in)</b>	Prof. Dr. Patrick Dienes
<b>Teilnahmevoraussetzungen</b>	<b>Formal:</b> nein
	<b>Inhaltlich:</b> Wirtschaftsmathematik, Statistik, Finanz- und Investitionswirtschaft,
<b>Prüfungsleistung</b>	ELN auf Basis einer schriftlichen Klausur (60 Minuten)
<b>Prüfungsvorleistung</b>	Projekt-/Gruppenarbeit
<b>Bewertung der Prüfungsleistung</b>	endnotenbildend
<b>Bestehenserblich</b>	ja
<b>Qualifikationsziele / Lernergebnisse</b>	<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"> <li>• Risikomanagementprozess</li> <li>• Quantitative Risikobewertung</li> <li>• Risikosteuerung mittels Finanzinstrumenten</li> <li>• Risikocontrolling</li> </ul> <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>

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