

## Ausschreibung Master-Seminar: Risikomanagement

### **Themenblock 1: Excelanwendungen im finanziellen Risikomanagement**

Ziel des Seminars ist es, fortgeschrittene Anwendungen in Microsoft Excel (oder einem analogen Tabellenkalkulationsprogramm) anhand relevanter Problemstellungen im Risikomanagement zu erarbeiten und zu implementieren. Grundlegende Excelkenntnisse werden als bekannt vorausgesetzt, es wird keine technische Einführung geben. Erläuterungen/Darstellungen zur Implementierung im Tabellenkalkulationsprogramm dürfen bis zu 50% der schriftlichen Seminararbeit ausmachen. Die Excel-Datei muss mit abgegeben werden.

- E1. Weiterentwicklungen der historischen Simulation zur Messung des Value at Risk
- E2. Alternative Möglichkeiten zur Bestimmung der Volatilität
- E3. Parametrische Ansätze zur Bestimmung des VaR: Normal- und t-Verteilung
- E4. Erweiterungen des VaR (z.B.: Incremental VaR, Gitter-Monte-Carlo-Simulation, CondVaR)
- E5. Ermittlung des Basiszinssatzes in der Unternehmensbewertung

### **Themenblock 2: Risikomanagement von manchmal vernachlässigten Themen**

Ziel des Seminars ist es, einen umfassenden Blick auf das Risikomanagement von Themen zu gewinnen, die oftmals nur schwer messbar sind und daher leicht vernachlässigt werden. Eingerahmt werden die Themen durch die Betrachtung unterschiedlicher Stufen des Risikomanagements.

- RM1. Risikomanagement von Personalrisiken
- RM2. Risikomanagement von Liquiditätsrisiken
- RM3. Risikomanagement von Cyberrisiken
- RM4. Risikomanagement im Mittelstand
- RM5. Das Reifegradmodell im Risikomanagement
- RM6. Entwicklung von Risikomanagement zur Risk Governance

## Anrechnung

Alle Themen sind im Risikomanagement (Master CRM) anrechenbar.

### Zu erbringende Leistungen/Terminplan:

- Themenverteilung: Sobald die Platzverteilung abgeschlossen ist, schicken Sie mir Ihre 3 Lieblingsthemen. Die Verteilung erfolgt dann bis spätestens 30.09.
- 1.10.2020, 9:00 Uhr: Einführungsveranstaltung mit (Kurz)Einleitung zum wissenschaftlichen Arbeiten
- 30.10.2020: Frist zur Gliederungsbesprechung
- 22.12.2020: Abgabe der Seminararbeit, formatiert gemäß der Formatvorlage des Lehrstuhls (s. Homepage Wiedemann), einzige Abweichung: Umfang des Textteils inkl. aller Abbildungen und Tabellen, exkl. Verzeichnisse und Anhänge: 18 Seiten. Die Abgabe erfolgt ins Postfach!
- Die Zulassung zu den Vorträgen erfolgt spätestens am 25.01.21, danach Vorbereitung der Präsentation mit den weiteren Bearbeitern des gleichen Themas.
- Die Vorträge zu den schriftlichen Arbeiten sind am 08./09.02.21 ganztags. Es besteht an beiden Tagen Anwesenheitspflicht, unabhängig von eigenen Veranstaltungen.

**Die genannten Termine sind Pflichttermine!** Bitte melden Sie sich folglich nur an, wenn Sie an den oben genannten Terminen anwesend sein können. Auf Überschneidungen mit sonstigen Lehrveranstaltungen kann leider nicht eingegangen werden. Die **Anmeldung und Platzvergabe** erfolgen zentral über unisono. Bitte beachten Sie bezüglich der Fristen die Veröffentlichungen auf der Homepage vom Prüfungsamt und/oder Dekanat.