

## SIMULATIONSBASIERTE, RISIKOGERECHTE BEWERTUNG MIT EXCEL: TEIL I GRUNDLAGEN – MIT FALLBEISPIEL UND PRAXISEMPFEHLUNGEN (ONLINE-SEMINAR)

Im Rahmen einer insgesamt dreiteiligen Seminarreihe wird erläutert, wie mit Hilfe von MS-Excel und dem Add-In Crystal Ball simulationsbasierte Risikoaggregationsmodelle entwickelt und die Ergebnisse der Simulation interpretiert werden können. Im ersten Teil der Seminarreihe werden gemeinsam die Grundlagen zum Aufbau von Risikoaggregationsmodellen gelegt. Das Seminar wird von der RMA Rating & Risk Academy GmbH in Kooperation mit der FutureValue Group AG und der EACVA GmbH durchgeführt.

Die Seminarreihe besteht aus einem Grundkurs und zwei Aufbaukursen. Alle Kurse können unabhängig voneinander gebucht werden!

### 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 können Aussagen zum Grad der Bestandsgefährdung getroffen werden und für ein Abwägen von Ertrag und Risiko ein risikogerechter Kapitalkostensatz bestimmt werden, wie es moderne Bewertungsverfahren fordern. 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 einperiodigen 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 aggregierten Ertragsrisikos
  - Identifikation und quantitative Beurteilung von Risiken mittels adäquater Wahrscheinlichkeitsverteilungen
  - Ableitung wesentlicher Risikokennzahlen: Grad Bestandsgefährdung und risikogerechter Kapitalkostensatz
- Einfaches Fallbeispiel in MS-Excel mit Crystal Ball
  - Ableitung stochastisches Modell aus Planungs- und Risikoinformationen
  - Modellierung wesentlicher Risiken (Anlegen von Verteilungen)
  - Anlegen von Zielgrößen
  - Ergebnisse einer Monte-Carlo-Simulation und deren Interpretation
  - Umsetzungsempfehlungen für die Praxis

## REFERENT

### Marco Wolfrum

Marco Wolfrum ist seit mehr als 25 Jahren als Unternehmensberater aktiv mit einem Schwerpunkt im Bereich entscheidungsorientiertem Risikomanagement. Er leitet als Partner bei der FutureValue Group AG den Bereich Leistungserstellung und übt in dieser Funktion die Leitung in einer Vielzahl von Projekten aus. Seit September 2014 ist Hr. Wolfrum Mitglied des Vorstands der RMA Risk Management & Rating Association e.V. und seit September 2021 Geschäftsführer der RMA Rating & Risk Academy GmbH. Herr Wolfrum ist zudem Autor zahlreicher Fachveröffentlichungen, nimmt Lehraufträge an diversen Hochschulen wahr und ist Referent bei verschiedenen Seminaranbietern. Seine Tätigkeitsschwerpunkte liegen im Review und der Weiterentwicklung von Risikomanagementsystemen in Unternehmen, im Aufbau von Managementsystemen zur Vorbereitung unternehmerischer Entscheidungen sowie im Auf- und Ausbau 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)

- 10. April 2024, 13:30 – 17:00 Uhr
- 18. September 2024, 13:30 – 17:00 Uhr

*3 Stunden Fortbildung bzw. 4 CPE im Rahmen der CVA-Rezertifizierung*

## TEILNAHMEGEBÜHR

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

- 299 € für Mitglieder der RMA oder der EACVA
- 349 € für Nicht-Mitglieder der RMA und der EACVA

## 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](#), der [FutureValue Group AG](#) und der [EACVA](#) entnommen werden.