

Operational Risk

Operational Risk

Schriftlicher Lehrgang „Operational Risk“ in 10 Lektionen

herausgegeben von

RiskNET Events
Meckelhof 5
D-79110 Freiburg i. Br.

E-Mail: oprisk@risknet.de

<http://oprisk.risknet.de>

Schriftlicher Lehrgang „Operational Risk“ in 10 Lektionen.

„Operational Risk“ betrifft jeden Manager und Mitarbeiter. Lernen Sie das Risiko und die möglichen Maßnahmen kennen, damit Sie in der Lage sind präventiv tätig zu werden. Sie steigern damit nachhaltig den Wert Ihres Unternehmens! Außerdem frischen Sie Ihr Wissen über Risikokapital auf, damit auch Sie in der Lage sind, die Verhandlungen zu verstehen und zu führen.

7 Gründe warum Sie teilnehmen sollten:

- Sie haben nicht die Zeit Seminare zu besuchen.
- Sie verfügen nur über ein eingeschränktes Aus- und Weiterbildungsbudget.
- Sie wollen in Ihrem eigenen Tempo den Lehrstoff be- und verarbeiten.
- Sie wollen später noch einmal praxisfallbezogen auf das Material zurückgreifen.
- Bei Bedarf wollen Sie den Autoren Ihr Problem vorlegen können und erwarten eine praxisorientierte und individuelle Lösung.
- Sie haben bei Seminaren bisher eher das Gefühl gehabt, dass auf Ihre individuellen Fragen und Herausforderungen nicht eingegangen wurde.
- Der Lehrgang wurde von anerkannten Praktikern und Wissenschaftlern erarbeitet und wird regelmäßig angepasst.

Dann ist dieses Angebot für Sie entwickelt, denn:

- Sie erhalten die einzelnen Lektionen im Wochenabschnitt und können sie verarbeiten, wenn Sie Lust und Zeit haben.
- Sie erhalten eine Lehrstoffmenge, die Sie normalerweise in vier zweitägigen Seminaren erhalten würden.
- Sie können den Lehrstoff so verarbeiten, wie es Ihnen am Besten passt. Sie können Stellen bei Bedarf auch jederzeit wiederholen.
- Das Material ist so konzipiert, dass Sie später einfach bestimmte Stellen nachschlagen können.
- Es gibt einen E-Mail-Service, damit Sie Ihre spezifischen Fragen den Autoren vorlegen können.

Haben Sie Fragen?

Wir helfen Ihnen gerne weiter.

RiskNET Events
RiskNET - The Risk Management Network
Frank Romeike
Meckelhof 5
D-79110 Freiburg i. Br.
Briefanschrift:
Postfach 60 43
D-79036 Freiburg i. Br.
E-Mail: romeike@risknet.de
Tel: +49-(0)761-8982-142
Fax: +49-(0)761-8982-143

Fachliche Leitung:

Dr. Gerrit Jan van den Brink
E-Mail: info@oprisk-management.de
Tel: +49-(0)6174-248751
Fax: +49-(0)6174-248749

Lehrgangsziel:

Neben den Seminaren und Universitätsvorlesungen gibt es momentan nur sehr eingeschränkt eine Möglichkeit sich in deutscher Sprache im Themenkomplex „Operational Risk“ fortzubilden. Dieser schriftliche Kurs soll die Lücke schließen. Folgende Ziele werden mit diesem Kurs verfolgt und erfüllt:

- Der Teilnehmer soll einen vertieften Einblick in allen Facetten des operationellen Risikos geboten werden, die er sich in seinem Tempo und auf einer von ihm bestimmten Zeit eigen machen kann.
- Der Teilnehmer ist anhand von Übungsaufgaben in der Lage autodidaktisch zu prüfen, ob er den Lehrstoff beherrscht.
- Der Teilnehmer hat die Möglichkeit bei Fragen per E-Mail mit dem Veranstalter dieses Kurses zu kommunizieren.
- Dieser Kurs ist gleichzeitig ein Nachschlagewerk, auf das der Teilnehmer in seiner täglichen Praxis zurückgreifen kann.

Für wen ist dieser Lehrgang bestimmt?

Operationelle Risiken sind im Gegensatz zu Kredit- oder Marktpreisrisiko nicht an bestimmten Stellen in der Organisation gebunden. Überall wo Menschen und Systeme in Prozessen unter Einfluss von externen Faktoren zusammenarbeiten, gibt es auch Operational Risk. Der Erfolg für Führungskräfte wird heute nicht nur durch das Erzielen der Leistungsplanung, sondern auch durch ein gutes Risikomanagement erreicht. Insbesondere für die Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter, die heute erstmalig mit Kapitalanforderungen konfrontiert werden, ist dieser Kurs ein wichtiges Instrument um den Erfolg nachhaltig abzusichern. Der Lehrgang richtet sich an Führungs- und Nachwuchskräfte, sowie Mitarbeiter und Mitarbeiterinnen aus folgenden Bereichen:

- Risikomanagement und -controlling
- Financial Controlling
- Gesamtbanksteuerung
- Qualitätsmanagement/Prozessoptimierung
- Marktfolge
- Innenrevision
- Strategische Unternehmensplanung

Des weiteren richtet sich dieser Kurs an die verantwortlichen Mitarbeiter für Corporate Governance sowie an Wirtschaftsprüfer, Unternehmensberater, Wirtschaftswissenschaftler und Lösungsanbieter.

Module (etwa 50-70 Seiten):

1. **OpRisk: Definition, Abgrenzung und Dimensionen**

- Risikodefinition und theoretisches Verständnis
- Operational Risk Definition
- Abgrenzung zu den anderen Risikoarten (Kredit-, Liquidität-, Strategisches- und Marktpreisrisiko)
- Sekundäre Risiken (Reputationsrisiko)
- Risikoklassifizierung (Ursache, Ereignis, Effektbezogen)

Dr. Björn Lenzmann

2. **Regulatorische Anforderungen**

- Basel II Consultative Document III
- Sound Practices
- EU-Paper
- Interpretationen in anderen Ländern (FSA, DNB)

Dr. Gerrit Jan van den Brink

3. **Aufbau- und ablauforganisatorische Aspekte**

- Rahmenwerk (Policy, Rollenverständnis, etc)
- Rolle des unabhängigen OR-Controlling Einheits
- Rolle der Innenrevision
- Rolle der Rechtsabteilung
- Rolle der Compliance Abteilung
- Rolle der Versicherungsabteilung

Dr. Gerrit Jan van den Brink

4. **Verlustdatensammlung**

- Umsetzung der regulatorischen Anforderungen
- Ziele der Verlustdatensammlung
- Herausforderungen bei der Verlustdatensammlung (z.B. Vollständigkeit und Klassifizierung)
- Die Benutzung externer Verlustdaten
- Der Verlustdatensammelprozess
- Datenqualitätsmanagement

Dr. Thomas Kaiser

5. Self-Assessment

- Ziele des Self-Assessments
- Herausforderungen bei dem Self-Assessment Prozess (z.B. Risikoeinschätzungen und Verzerrungen)
- Analyse und Validierung der Ergebnisse
- Der Self-Assessment Prozess (Vorbereitung, Durchführung und Unterstützung durch die OR-Controllingeinheit)

Prof. Dr. Arnd Wiedemann und Marc Kaninke

6. Risiko-Indikatoren

- Erfüllung der regulatorischen Anforderungen
- Ziele eines Risikoindikatorensystems
- Voraussetzungen für ein funktionierendes Risikoindikatorsystem
- Eigenschaften funktionierender Risikoindikatoren
- Definitionsprozess
- Überwachungsprozess
- Validierung der RI

Dr. Gerrit Jan van den Brink

7. Quantifizierung des Operational Risk

- Erklärung der wichtigsten statistischen Begrifflichkeiten und Verfahren
- Erfüllung der regulatorischen Anforderungen
- Unterschiedliche Quantifizierungsmöglichkeiten
- Bestimmung der Datenbasis
- Parametrisierung
- Modellierung (inkl. Korrelationen/Abhängigkeiten)
- Validierung

Dr. Christian Stögbauer

8. OR-Reporting

- Anforderungen an das Reporting
- Der Reporting-Prozess
- Analyse als Basis für den Reporting-Prozess
- Aufzeichnung des Handlungsbedarfs für das Management

Mag. Franz Reif und DI Dr. Andreas Weingessel

9. Management Operationeller Risiken

- Integration von Operational Risk in das Risikomanagement des Unternehmens
- Einbindung der quantitativen Ergebnisse in die Gesamtrisikosteuerung
- Operational Risk Management Prozess
- Operational Risk Management und ausgelagerte Aktivitäten
- Welche Incentives fördern ein gutes Operational Risk Management?

Dr. Michael Auer





10. Risk Mitigation und Risk Transfer

- Techniken der Risk Mitigation
- Traditionelle Versicherungslösungen
- Grenzen der traditionellen Risikofinanzierung
- Alternative Wege der Risikofinanzierung und des Risikotransfers
- Hybride Risikofinanzierungslösungen
- Captives als moderner Weg der Risikofinanzierung

Frank Romeike

Das Autorenteam

Die Autoren zählen zu den führenden Praktikern und Wissenschaftlern auf das Fachgebiet Operational Risk. Nicht nur fachliche, sondern auch didaktische Fähigkeiten bringen Sie in diesen Lehrgang ein.

	<p>Dr. Michael Auer Head of Operational Risk Control HVB</p>
	<p>Dr. Gerrit Jan van den Brink Dresdner Bank AG</p>
	<p>Dr. Thomas Kaiser Senior Manager KPMG Head of Operational Risk Financial Risk Management Business Services</p>
	<p>Dr. Björn Lenzmann Commerzbank AG</p>
	<p>Mag. Franz Reif Head of Group Risk Control Erste Bank</p>

	Frank Romeike Herausgeber RISKNEWS, Stv. Chefredakteur Bank-Verlag
	Dr. Christian Stögbauer Bayerische Landesbank
	DI. Dr. Andreas Weingessel - Head of Group Operational Risk Control Erste Bank
	Prof. Dr. Arnd Wiedemann – In- haber des Lehrstuhls für Finanz- und Bankmanagement, Universi- tät Siegen

Anmeldung

Per Fax
+49(0)6174 248749

- Ich melde mich **verbindlich** für den schriftlichen Lehrgang „Operational Risk“ zum Preis vom € 1.590,-- zzgl. 16% MwSt. pro Person an.

Name:	
Vorname:	
Position:	
Abteilung:	
Firma:	
Anschrift: Straße: Postleitzahl: Ort:	
Telefon:	
Fax:	
E-Mail:	

Wenn die Rechnung an eine andere Person verschickt werden soll, bitten wir Sie folgende Informationen auszufüllen:

Name:	
Abteilung:	
Anschrift: Straße: Postleitzahl: Ort:	

Teilnahmebedingungen: der Preis für diesen Lehrgang beträgt €1.590,-- zzgl. 16% MwSt. pro Person und ist nach Erhalt der Rechnung fällig. Nach Eingang Ihrer Anmeldung senden wir Ihnen eine Bestätigung.

Datum, Unterschrift