

Thema	Risikomanagement: Aufgabensammlung II
Dokumentart	Aufgabensammlung
Theorie im Buch "Integrale Betriebswirtschaftslehre"	Teil: E2 Risikomanagement

Risikomanagement: Aufgabensammlung II

Aufgabe 1

1.1

Risikomanagement lässt sich als Prozess verstehen. Nennen und erläutern Sie dessen vier Schritte.

1.2

Welche Taktiken können zur Risikobewältigung eingesetzt werden?

Aufgabe 2

2.1

Handlungsbedarf bezüglich bestimmter Gefahrenszenarien kann durch gesetzliche Schutzziele vorgeschrieben werden. Auf der anderen Seite kann ein Risikoeigner – beispielsweise aus Kosten/Nutzen-Überlegungen – frei entscheiden. In einem solchen Fall wird ein Soll/Ist Vergleich der Risikolandschaft herbeigeführt. Erklären Sie diesen.

2.2

In welchem Fall wird die Entscheidung zur Risikominderung gefällt?

Aufgabe 3

Der Geschäftsgang und der Unternehmenswert werden durch das Risikomanagement beeinflusst. Die Einflüsse können unter anderem über die Erfolgsrechnung (Geschäftsgang) und die Unternehmensbewertung (Unternehmenswert) erfolgen. Erläutern Sie diese beiden Wirkungsketten.

Aufgabe 4

Erläutern sie die Fehlerbaumanalyse.

Aufgabe 5

Die Ereignisse X und Y sind unabhängig voneinander. Die Wahrscheinlichkeit, dass Ereignis A eintritt, ist 30 %, jene, dass Ereignis B eintritt, ist 10 %.

5.1

Wie gross ist die Wahrscheinlichkeit, dass beide Ereignisse gleichzeitig eintreten (keine Berücksichtigung des Schadensausmasses)?

5.2

Wie hoch wäre die Wahrscheinlichkeit, wenn die Ereignisse vollständig korrelieren würden (keine Berücksichtigung des Schadensausmasses)?

5.3

Wie hoch wäre die Wahrscheinlichkeit, wenn die Ereignisse vollständig negativ korrelieren?

Aufgabe 6

Erstellen sie eine Risikolandschaft (inkl. Beschriftungen) und bezeichnen sie die drei ihnen bekannten Risikobereiche.

Aufgabe 7

Erklären Sie den Begriff Schutzziel.

Aufgabe 8

Was verstehen Sie unter dem Begriff „Value at Risk (VaR)“?