# Вопросы к зачету по дисциплине «Управление рисками»

# специальности 38.05.01 Экономическая безопасность

* + 1. Теория риска в классической школе.
		2. Маржиналистская теория риска.
		3. Взгляды неоклассиков на теорию риска.
		4. Институциональная теория риска.
		5. Основные критерии классификаций и виды рисков.
		6. Основные источники теории и практики управления рисками.
		7. Цели и задачи управления рисками.
		8. Принципы управления рисками.
		9. Основные подходы к управлению рисками.
		10. Культура управления рисками (риск аппетит, склонность к риску).
		11. Статистика и теория вероятности как источник для развития теории и практики управления рисками.
		12. Теория надежности.
		13. Стандарты управления риском.
		14. Взаимодействие системы управления риском с другими управленческими функциями.
		15. Процесс оценки рисков и его основные этапы.
		16. Подходы к оценке рисков.
		17. Распределение вероятностей и оценка рисков.
		18. Идентификация рисков.
		19. Цели и задачи качественного анализа рисков.
		20. Методы качественного анализа рисков.
		21. Цели и задачи количественного анализа рисков.
		22. Методы количественного анализа рисков.
		23. Сравнительная оценка рисков.
		24. Оценка вторичных рисков.
		25. Назначение и структура карты рисков.
		26. Этапы процесса управления рисками.
		27. Методы управления рисками.
		28. Оценка эффективности методов управления рисками.
		29. Интегрированный подход к организации системы управления рисками и внутреннего контроля.
		30. Практика риск-менеджмента международных компаний.
		31. Методы оценки и покрытия рисков в современных международных концепциях.
		32. Модель COSO. Структура и функционирование модели.
		33. Координация риск-менеджмента и внутреннего контроля. Роль внутреннего аудита.
		34. Инвестиционный портфель и его формирование.
		35. Риск инвестиционного портфеля и способы его измерения.
		36. Оптимальный инвестиционный портфель.
		37. Стратегия управления инвестиционным портфелем.
		38. Цели формирования инвестиционного портфеля.
		39. Активная, пассивная модель управления портфелем. Стратегия структурирования портфеля.
		40. Понятие и классификация финансовых рисков
		41. Процентные риски: понятие и источники возникновения.
		42. Риски инфляции и преодоление искажающего влияния.
		43. Валютные риски и их классификация.
		44. Операционные риски и их источники.
		45. Кредитные риски: оценка и управление.
		46. Риски ликвидности и их оценка.
		47. Риски банкротства и модели определения вероятности банкротства.
		48. Страновой риск и инвестиционный климат.
		49. Структура странового риска.
		50. Методы оценки странового риска.
		51. Система предупреждения рисков.