# 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.