

ВОПРОСЫ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

(к зачету по учебной дисциплине «Моделирование рисков»
для студентов специальности 6-05-0811-04 Агробизнес)

1. Сущность и виды риска. Риск: основные этапы становления теории.
2. Понятие риска, его функции. Виды рисков.
3. Понятие риска как экономической категории.
4. Понятие неопределенности и риска. Основные виды неопределенностей в экономической деятельности.
5. Классификация рисков.
6. Основные черты риска.
7. Факторы риска.
8. Природа риска.
9. Управление рисками предприятия.
10. Характеристика основных элементов системы управления рисками предприятия.
11. Алгоритм управления рисками предприятия.
12. Методы управления рисками: принципы управления, алгоритм управления.
13. Процесс управления операционными рисками.
14. Сущность и подходы к оценке уровня финансовых рисков.
15. Качественные методы оценки рисков.
16. Метод экспертных оценок.
17. Метод Дельфи.
18. Метод Комиссии.
19. Метод суда.
20. Анализ причин и последствий.
21. Структурированный анализ сценариев методом «что, если?».
22. Анализ сценариев.
23. Анализ вероятностных распределений потоков платежей.
24. Метод Мозгового штурма.
25. Количественные методы оценки рисков.
26. Метод финансовых коэффициентов.
27. Метод анализа чувствительности.
28. Имитационное моделирование (Метод Монте-Карло).
29. Метод САРМ. Метод анализа «затраты – выгода».
30. Матрицы последствий и матрицы рисков
31. Модель, как инструмент прогнозирования рисков.
32. Программные продукты для моделирования рисков.
33. Подходы к измерению рисков.
34. Модель оценки странового риска.
35. Совокупный риск.
36. О риске ликвидности как совокупном риске.
37. Факторные модели оценки совокупного риска.

38. Прогнозирование банкротства, как методология оценки совокупного риска.

39. Зарубежные модели моделирования риска. Отечественные модели моделирования риска.

40. Способы оценки финансового риска.

41. Управление финансовыми рисками.

42. VAR-метод оценки финансовых рисков.

43. Среднее квадратичное в измерении уровня риска.

44. Модели расчета финансового риска.

45. Инвестиционный риск.

46. Модели расчета инвестиционного риска.

47. Рисковое страхование.

48. Кредитный риск.

49. Модели расчета кредитного риска.

Форма контроля: устно/письменно