

УТВЕРЖДЕНО:

Зав. кафедрой «Экономика, финансы и менеджмент» _____ М.В. Корниенко

Протокол № _____ от «27» _____ 2022 года

Примерный перечень вопросов и практико-ориентированных заданий к экзамену по дисциплине «Риск-ориентированный подход в анализе рисков» для студентов, обучающихся по направлению 38.03.01 Экономика, профиль «Анализ и управление рисками организации»

2021/2022 учебный год

1. Принятие решений в условиях определенности, риска и неопределенности: характерные черты и основные отличия.
2. Систематические и несистематические риски. Диверсификация. Зависимость риска портфеля активов от диверсификации активов.
3. Модель оценки финансовых активов. Основные предположения, на которых базируется модель.
4. Оценка рисков на основе риск-ориентированного подхода и ее место в общей схеме управления рисками.
5. Источники информации, необходимые для проведения оценки риска на основе риск-ориентированного подхода.
6. Этапы оценки риска на основе риск-ориентированного подхода.: качественный и количественный.
7. Основные группы методов оценки рисков на основе риск-ориентированного подхода (статистические, вероятностно-статистические, теоретико-вероятностные, экспертные), их краткая характеристика и недостатки.
8. Области применения методов оценки риска.
9. Статистические методы оценки рисков на основе риск-ориентированного подхода.
10. Экспертные методы оценки рисков на основе риск-ориентированного подхода.
11. Общие сведения о методе экспертных оценок, его основные отличия от других групп методов оценки риска.
18. Индивидуальные и групповые экспертные оценки деятельности предприятия на основе риск-ориентированного подхода: их достоинства и недостатки.

19. Методы получения экспертной информации (открытое обсуждение, свободное высказывание без обсуждения, закрытое обсуждение с последующим закрытым голосованием), их основные характеристики и недостатки.
20. Суть метода Дельфи как метода получения экспертной информации. Основные принципы и процедура метода Дельфи.
21. Метод построения дерева решений на основе риск-ориентированного подхода.
22. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта.
23. Метод корректировки коэффициента дисконтирования на риск инвестиционного проекта.
24. Риски, учитываемые при определении премия за риск (поправки на риск).
25. Управление рисками на основе риск-ориентированного подхода
26. Основные методы управления риском (уклонение, снижение, передача, принятие риска на себя), их характеристика.
27. Составляющие метода снижения рисков: диверсификация, лимитирование, хеджирование. Их краткая характеристика.
28. Составляющие метода передачи рисков: страхование рисков, метод поиска гаранта, факторинг, франчайзинг. Их краткая характеристика.

К.э.н., доцент кафедры
«Экономика, финансы и менеджмент»



Баженова С.А.