

УТВЕРЖДЕНО:  
Зав. кафедрой «Экономика, финансы и менеджмент»  
М.В. Корниенко  
Протокол № 6 от «27» 01 2022 года.

**Примерный перечень вопросов к экзамену по дисциплине «Управление рисками в корпорациях» для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент»  
профиль «Корпоративное управление» (очная форма обучения)**

**2021/2022 учебный год**

1. Понятие риска в научном и прикладном значениях
2. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску ЛПР
3. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску.
4. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску.
5. В чем различие между чистыми и спекулятивными рисками. Назовите примеры тех и других.
6. Какие классификации рисков Вам известны.
7. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков
8. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.
9. Этапы диагностики рисков компании.
10. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль.
11. Установление актуального рискового профиля.
12. Абсолютные показатели колеблемости (вариации).
13. Рисковость актива и портфеля.
14. Метод анализа чувствительности в управлении риском.
15. Метод сценариев оценки риска
16. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков
17. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском

18. Метод Монте–Карло (статистических испытаний)
19. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
20. Координация (согласование) мнений экспертов.
21. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
22. Ставка свободная от риска. Доходность безрисковых активов
23. Премия риска рыночного портфеля
24. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP - Implied Equity Risk Premium
25. Методы, используемые на этапе выявления рисков
26. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий
27. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
28. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия
29. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
30. Эвристические правила риск – менеджмента
31. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций
32. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.
33. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.
34. Определение предельно допустимого уровня финансовых рисков по отдельным финансовым операциям и видам финансовой деятельности корпорации
35. Инструменты снижения финансового риска: опционы, фьючерсы.
36. Хеджирование как инструмент управления финансовыми рисками

К.э.н., доцент



---

Б.Б. Зайковский