

**Перечень вопросов для подготовки к зачету по дисциплине
«Финансовые риски корпоративного инвестирования»**

1. Понятие финансовых рисков и их классификация.
2. Основные принципы и методы управления финансовыми рисками.
3. Функции и механизм управления финансовыми рисками предприятия.
4. Основные этапы процесса управления финансовыми рисками.
5. Учет фактора инфляции в процессе управления риском.
6. Диверсификация и снижение риска.
7. Хеджирование, его экономическая целесообразность.
8. Систематические и несистематические финансовые риски.
9. Финансовые составляющие процесса управления рисками.
10. Страхование в системе управления рисками на предприятии.
11. Управление кредитным риском.
12. Управление риском ликвидности.
13. Управление процентным риском. Содержание, значение и факторы процентного риска.
14. Методы управления процентным риском.
15. Управление валютным риском. Содержание, факторы и виды валютного риска.
16. Методы управления валютным риском.
17. Управление агрегированными финансовыми рисками инвестиционной деятельности.
18. Риски и диверсификация инвестиционного портфеля.
19. Система лимитов как инструмент ограничения риска портфеля ценных бумаг.
20. Виды лимитов и принципы их установления.
21. Показатель потенциальных потерь портфеля VaR: достоинства и недостатки.
22. Использование показателя VaR для измерения рыночных рисков.
23. Показатели чувствительности.
24. Коэффициент β в модели CAPM.
25. Метод сценариев. Стресс-тестирование.
26. Источники риска при реализации инвестиционного проекта и их классификация.
27. Стадии жизненного цикла проекта и риски, им сопутствующие.
28. Анализ чувствительности инвестиционного проекта.
29. Сущность качественного анализа проектных рисков.
30. Методы качественного анализа проектных рисков.
31. Методы количественного анализа проектных рисков.
32. Сценарный подход к оценке рисков реального инвестирования.

33. Метод имитационного моделирования.

34. Классификация рисков, возникающих на инвестиционной фазе реализации инвестиционного проекта

35. Риски, связанные с заключением договоров на производство строительного-монтажных работ и поставку оборудования.

36. Риски эксплуатационной фазы реализации инвестиционного проекта.

37. Этапы и организация риск-менеджмента инвестиционного проекта.