

Вопросы по курсу «Управление финансовыми рисками»

1. Понятия неопределенности и риска в экономической деятельности.
2. Финансовый риск как объект управления.
3. Основные виды финансовых рисков.
4. Сущность финансового риска как экономической категории.
5. Классификация рисков хозяйственной деятельности.
6. Сущность, содержание и виды финансовых рисков.
7. Основные функции риск-менеджмента.
8. Риск-менеджмент как система управления финансовыми рисками.
9. Сущность и содержание риск-менеджмента.
10. Организационные этапы риск-менеджмента.
11. Эвристические правила риск менеджмента.
12. Стратегия риск-менеджмента.
13. Приемы управления финансовым риском.
14. Основные средства разрешения финансовых рисков.
15. Методы снижения степени риска.
16. Диверсификация как способ снижения финансового риска.
17. Страхование как способ снижения коммерческого риска.
18. Хеджирование как способ снижения ценовых рисков.
19. Страхование и хеджирование: общие черты и различия.
20. Сущность и назначение эккаунтинга в управлении рисками.
21. Понятия систематического и несистематического рисков.
22. Методы снижения систематического риска.
23. Несистематический риск и способ его снижения.
24. Самострахование как способ снижения риска.
25. Сущность лимитирования как способа снижения финансового риска.
26. Коэффициент риска инвестора: его определение и содержание.
27. Основные способы определения суммы страхового возмещения при страховании рисков.
28. Франшиза, ее основные виды и значение для страхования рисков.
29. Основные стратегии хеджирования.
30. Хеджирование с помощью форвардных и фьючерсных операций.
31. Хеджирование с помощью опционов.
32. Критерии степени риска.
33. Количественные методы измерения финансовых рисков.
34. Инвестиционные риски и методы их измерения.
35. Определение среднего ожидаемого значения и степени отклонения при оценке риска.
36. Коэффициент вариации: определение и значение при оценке риска.
37. Риск и доходность финансовых активов.
38. Взаимосвязь показателей риска и доходности.
39. Отношение к риску через кривые функций полезности.
40. Понятие риска инвестиционного портфеля.
41. Оценка общего риска портфеля ценных бумаг.
42. Модель оценки доходности и риска финансовых активов (CAPM)
43. Определение β -коэффициента ценной бумаги.
44. Определение β -коэффициента портфеля ценных бумаг.
45. Определение систематического риска портфеля ценных бумаг.
46. β -Коэффициент и его значение при определении риска финансовых активов.
47. Определение среднего квадратического отклонения при оценке риска.
48. Определение размаха вариации при оценке риска финансовых активов.
49. Метод пропорциональной ответственности при страховании рисков.
50. Определение субъективной и объективной вероятности события при оценке степени риска.

Составила канд.экон. наук, доцент МФЮА Поморцева И.М.