**Контрольные вопросы к экзамену**

1. Цели, задачи и принципы анализа и оценки рисков.

2. Критерии Б. Берлимера.

3. Количественный и качественный анализ риска.

4. Классифицирование угроз и возможностей возникновения рисков.

5. Формы и методы анализа, прогнозирования и оценки рисков, применяемые в зарубежной практике.

6. Анализ чувствительности критериев эффективности (чистый дисконтированный доход (NPV), внутренняя норма доходности (IRR) и др.).

7. Метод сценариев.

8. Методы имитационного моделирования (Монте-Карло) и др.

9. Анализ вероятностных распределений потоков платежей.

10. Построение деревьев решений.

11. Построение детерминированных и стохастических аналитических моделей риска.

12. Методы теории нечетких множеств и нечетких интервалов.

13. Метод корректировки нормы дисконта (премии за риск).

14. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов достоверности).

15. Аналитические и численные методы Value at risk – VAR, используемые для оценки возможных потерь, рыночной стоимости портфеля ценных бумаг.

16. Основы системы SPAN и Eurex.

17. Основы системы SPAN: основные принципы и особенности.

18. Система рискового маржирования биржи Eurex.

19. Концепция рисковой стоимости. Достоинства и недостатки VAR

20. Вероятностное распределение ключевых факторов риска.

21. Методы VAR: линейный, квадратичный.

22. Численные методы расчета.

23. Теоретические основы методов и моделей оценки рисков в деятельности хозяйствующих субъектов.

24. Хозяйственные риски. Внешние и внутренние факторы, влияющие на величину хозяйственных рисков.

25. Функции хозяйственного риска.

26. Методы и модели анализа рисков.

27. Статистический метод.

28. Метод аналогий и др.

29. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности.

30. Принятие оптимальных решений в условиях неопределенности.

31. Основные понятия теории игр. Предмет теории игр. Понятие игр с природой.

32. Методы решения многокритериальных задач.

33. Сравнительная оценка вариантов решения в зависимости от критериев эффективности.

34. Оптимальность по Паретто.

35. Определение оптимального объема производства.

36. Критерии оптимальности в условиях полной неопределенности

37. Критерий Гурвица.

38. Критерий Сэвиджа.

39. Критерий Вальда.

40. Критерий среднего выигрыша.

41. Критерий Лапласа.

42. Критерий максимакса.

43. Современные методы оценки и управления рисками.

44. Основные тенденции и направления управления рисками.

45. Основные задачи.

46. Управление рисками по типам рисков.

47. Управление рыночными, кредитными, операционными, рисками рыночной ликвидности и др.

48. Систематизация методов количественного анализа, используемых в риск-менеджменте.