

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования  
«Северный (Арктический) федеральный университет имени М.В. Ломоносова»

Кафедра финансов и кредита  
Направление 38.03.01 Экономика, заочники

ВОПРОСЫ к зачету  
по дисциплине «Риск-менеджмент»  
преподаватель – канд.экон.наук, доцент Микитюк Валентина Анатольевна

1. Сущность неопределенности и хозяйственного риска.
2. Общая характеристика хозяйственных рисков, их классификация.
3. Понятие финансового риска, его особенности и виды.
4. Основные факторы, влияющие на уровень финансовых рисков предприятия
5. Риск-менеджмент как составная часть финансового менеджмента.
6. Концепция компромисса между риском и доходностью.
7. Концепция операционного и финансового рисков предприятия.
8. Сущность риск-менеджмента, его цели и задачи
9. Объекты и субъекты риск-менеджмента
10. Принципы риск-менеджмента
11. Содержание политики управления финансовыми рисками
12. Методы управления финансовыми рисками
13. Способы снижения финансовых рисков
14. Методы оценки финансовых рисков
15. Показатели оценки риска
16. Качественный анализ рисков
17. Количественный анализ рисков
18. Зоны и области рисковой деятельности
19. Экономико-статистические методы оценки риска.
20. Оценка риска структуры активов по степени их ликвидности
21. Оценка риска потери платежеспособности по абсолютным показателям.
22. Оценка риска потери платежеспособности по относительным показателям
23. Оценка риска потери финансовой устойчивости по абсолютным показателям.
24. Оценка риска потери финансовой устойчивости по относительным показателям.
25. Оценка риска банкротства предприятия по российским моделям.
26. Оценка риска банкротства по международным моделям.
27. Виды рисков инвестиционных проектов
28. Качественные методы анализа рисков инвестиционных проектов.
29. Количественные методы оценки рисков инвестиционных проектов.
30. Поправки на риск при выборе ставки дисконтирования.
31. Меры снижения инвестиционных рисков
32. Риск инвестирования в отдельный финансовый актив.
33. Риск инвестиционного портфеля.

34. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг CAPM (Capital Asset Pricing Model).
35. Способы снижения риска инвестиционного портфеля.
36. Анализ безубыточности и производственный риск компании
37. Оценка риска привлечения заемных средств с использованием ЭФР.
38. Оценка денежных потоков с учетом фактора риска.
39. Взаимосвязь показателя WACC и риска компании/
40. Показатели экономического эффекта и эффективности с учетом риска: EVA, RAROC.