**ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЕ ВОПРОСЫ**

**Тема 1:Риск ,как экономическая категория.**

**1 .**Риск, как экономическая категория. Сущность и виды рисков.

2.Классификация рисков

3.Основные черты риска.. Природа риска.

4.Поняти неопределенности и риска. Основные виды неопределенностей

5.Факторы риска. Внешние факторы риска.

6.Факторы риска . Внутренние факторы риска.

**Тема2 : Анализ и оценка риска в системе управления предприятием.**

1.Управления рисками предприятия. Основные принципы и этапы управления рисками предприятия.

2.Алгоритм управления рисками предприятия. Методы управления рисками предприятия.

3.Операционные риски предприятия. Процесс управления операционными рисками предприятия.

4. Алгоритм анализа рисков предприятия.

**ТЕМА 3: « Измерители и показатели производственных рисков»**

1.Математические методы и модели рисков.

2,Система показателей оценки риска.

3.Процесс управления операционными рисками.

4.Качественный и количественный анализ рисков.

5. Кривая риска и методы построения кривой риска.

**ТЕМА4: « Методы анализа и оценка рисков предприятия**

1.Методы анализа рисков.

2. Оценка риска в условиях частичной неопределенности. Вероятностные показатели оценки риска (точечная оценка риска ,оценка риска с помощью коэффициентов.) Предельные значения показателей риска.

3. Оценка риска в условиях частичной неопределенности. Вероятностные показатели оценки риска(интервальная оценка риска, общая характеристика метода VaR).

4. Оценка риска в условиях частичной неопределенности .Статистические показатели риска.(среднее значение, показатель размах вариации, дисперсия)

5. Оценка риска в условиях частичной неопределенности Статистические показатели риска.( среднее квадратическое отклонение, коэффициент вариации.)

6. Оценка риска в условиях частичной неопределенности. Преимущества и недостатки вероятностных и статистических показателей оценки риска.

**ТЕМА 5 «Методы оценки рисков в условиях неопределенности».**

1. Матрица последствий и матрица рисков.

2.Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило оптимизма (максимакса) и Вальда.

3. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило пессимизма правило Сэвиджа.

4. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило Гурвица.

5. Критерии принятия решений в условиях частичной неопределенности.

6.Критерии рациональности Лапласа (равно возможности ,безразличия).

**ТЕМА 6 «Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг**.

1.Портфель ценных бумаг. Типы портфелей роста. Типы портфелей дохода.

2.Основные принципы формирования портфеля ценных бумаг.

3.Модели оценки рисков инвестиционного портфеля.

4.Портфель Марковица и Тобина максимальной эффективности.

5. Оптимальность по Парето.

6.Характеристика моделей портфелей ценных бумаг.

**ТЕМА 7 «Экспертные методы оценки риска»**

1. Оценка риска в условиях полной неопределенности. Экспертные оценки, как методы принятия рисковых решений.

2.Экспертные методы оценки риска. Коллективные методы работы экспертной группы. Индивидуальные мнения экспертов.

3.Этапы организации экспертных методов оценки риска.

4.Методы статистической обработки результатов экспертизы.

5.Метод «мозгового штурма»

6. Метод «Дельфи».Этапы реализации метода «Дельфи».

7.Оценка степени согласованности мнения экспертов .( коэффициент вариации ,коэффициент ранговой корреляции Спирмена , коэффициент конкордации).

8.Алгоритм экспертного анализа риска.