**Вопросы для подготовки к экзамену**

**по курсу «Финансовые риски в условиях глобализации»**

1. Понятие «риск», его виды и типы по основным классификационным признакам.

2. Финансовый риск: сущность и классификация

3. Сущность и функции финансового риск-менеджмента

4. Система финансового риск-менеджмента: основная характеристика и элементы

5. Цели и задачи системы финансового риск-менеджмента

6. Основные этапы управления финансовыми рисками

7. Сущность риск-анализа, его основные этапы.

8. Методы и инструменты качественной и количественной оценки финансовых рисков.

9. Основные способы ограничения и управления финансовыми рисками.  
Способы хеджирования финансовых рисков.

10. Сущность и виды страхования финансовых рисков.

11. Сущность диверсификации финансовых рисков, типы диверсификации.

12. Сущность и механизм лимитирования финансовых рисков. Понятие индивидуального, совокупного, текущего лимита.

13. Сущность финансирования рисков. Основные методы финансирования рисков, их характеристика.

14. Рыночный риск: сущность, классификация и формы

15. Процентный риск: сущность и классификация

16. Валютный риск: сущность и классификация

17. Количественные показатели рыночного риска

18. Метод разрывов процентной структуры

19. Методология рисковой стоимости (VAR)

20. Параметрический (аналитический) метод расчета VAR

21. Метод исторического моделирования

22. Метод имитационного моделирования Монте-Карло

23. Метод стресс-тестирования

24. Механизмы управления рыночным риском

25. Кредитный риск: сущность и классификация

26. Внутренний кредитный риск: сущность и классификация

27. Внешний кредитный риск: сущность и классификация

28. Риск дефолта: сущность и классификация

29. Сущность рейтингового анализа, его значение в оценке и снижении рисков.

30. Классический подход анализа кредитоспособности заемщика

31. Количественные компоненты кредитного риска и их сущность

32. Методические подходы оценки вероятности наступления дефолта

33. Методы управления кредитным риском

34. Риск ликвидности: сущность и классификация

35. Риск ликвидности актива: сущность и классификация

36. Риск балансовой ликвидности: сущность и классификация

37. Методы оценки риска рыночной ликвидности и их сущность

38. Методы оценки риска балансовой ликвидности и их сущность

39. Операционный риск: сущность и классификация

40. Методы оценки операционного риска и их сущность

41. Методы управления операционным риском