

Фамилия, группа _____

1. Понятие «чистая неопределенность» предполагает, что будут учитываться:

- как позитивные, так и негативные отклонения случайных величин
- только негативные отклонения случайных величин
- только позитивные отклонения случайных величин

2. Риск, возникающий вследствие колебаний цен, процентных и тарифных ставок, курсов валют называется:

- риск ликвидности
- рыночный риск
- кредитный риск
- операционный риск

3. Риск, возникающий у компании, давшей отсрочку платежа по договору поставки продукции, называется:

- риск ликвидности
- кредитный риск
- технологический риск
- операционный риск

4. Риск, возникающий вследствие возможных несогласованных действий акционеров компании, называется:

- стратегический риск
- риск персонала
- риск собственников

5. Целью управления рисками является:

- исполнение компанией взятых на себя обязательств
- максимизация прибыли компании
- выполнение плана продаж

6. Операционный риск включает в себя:

- технологический риск
- финансовый риск
- рыночный риск

7. Распределение средств по многим видам активов для цели ограничения рисков называется:

- диверсификация рисков
- хеджирование рисков
- диссипация рисков

8. В случае возникновения потерь вследствие воздействия макроэкономического риска, все остальные риски, как правило,

- уменьшаются
- увеличиваются
- остаются неизменными

9. Оценка устойчивости компании к экстремальным событиям определяется путем:

- вероятностных методов
- стресс-тестирования
- метода статистических испытаний

10. Решение задач оценки рисков начинается с:

- количественной оценки рисков
- идентификации и классификации рисков
- создания резервов под возможные потери