

《风险管理》：风险管理：包括风险原理、企业面临的风险、风险管理的实践与目标、风险识别、风险评估、风险管理的措施及选择等内容。考察学生对风险管理的基本思想、基本方法及本领域基本知识的掌握程度；注重对学生知识结构和理论功底考察，尤其是对学生使用风险管理原理分析和处理风险事故能力的考察。

《风险管理》考试大纲

一、风险原理

风险与不确定性
风险的主要学说
风险的度量
风险的本质

二、企业面临的风险

风险的分类
企业风险的主要类型

三、风险管理的实践

风险管理的起源与发展
风险管理的组织
风险管理的程序

四、风险成本与风险管理的目标

风险的成本
风险管理的目标

五、风险识别

风险源
风险识别的基本方法:风险清单
风险识别的辅助方法

六、企业财产风险分析

企业财产的类型与权益
潜在财产直接损失金额的评估
企业财产损失的原因

七、法律责任风险分析

民事侵权责任的类型
过失责任
损害的赔偿
典型责任问题

八、人力资本风险分析

人力资本风险概述

人力资本风险的估算

九、金融风险分析

金融风险的类型与性质

市场风险的评估

十、损失分布

概率论与数理统计的基本概念

常用的损失分布及性质

获得损失分布的一般过程

十一、风险评估模型

大数定律与中心极限定理

损失频率的估算

损失幅度的估算

所需暴露单位的数量

十二、风险管理的措施

控制型风险管理措施的目标与理论基础

基本的控制型风险管理措施

基本的融资型风险管理措施

内部风险抑制

十三、保险

保险的运行与作用

保险的原理:风险汇聚

风险汇聚与保险公司的偿付能力不足风险

保险公司偿付能力不足风险的管理

十四、民事侵权责任体系

民事侵权责任体系的经济目标

为什么需要民事侵权责任体系

员工赔偿的经济作用

十五、员工福利计划

社会保险

团体医疗费用保险

退休计划

十六、套期保值

衍生工具简介

利用期权进行套期保值

利用期货与远期进行套期保值

利用互换进行风险管理

十七、风险管理决策模型

期望损益决策模型

期望效用决策模型

马尔可夫风险决策模型

随机模拟

十八、巨灾风险管理

巨灾风险的特点与趋势

巨灾风险保险与再保险

