

Питання до заліку

1. Основні причини виникнення економічного ризику та його елементи.
2. Класифікація видів ризику.
3. Динамічний та статичний ризик.
4. Систематичний (ринковий) та несистематичний (специфічний) ризик.
5. Якісний та кількісний аналіз ризику.
6. Статистичний, аналоговий та експертний методи кількісного аналізу ризику.
7. Міри ризику та їх порівняльна характеристика.
8. Ризик в абсолютному виразі.
9. Ризик у відносному виразі.
10. Оцінка ризику відхилення економічних показників від сподіваного значення за допомогою нерівності Чебишева, правила 3-х сігм, інших нерівностей.
11. Інтервали надійності. Вибір рівня надійності. Точковий та інтервальний прогноз.
12. Допустимий, критичний та катастрофічний ризику для оцінки банкрутств та привабливості інвестиційних та інноваційних проектів.
13. Коефіцієнт чутливості бета.
14. Концепція дюрації Маколея.
15. Модифікована дюрація.
16. Загальне правило управління процентним ризиком.
17. Компромісні рішення та оцінка ризику (інформаційні ситуації).
18. Правила прийняття рішень без використання кількісних значень імовірнісних ісходів (критерії Вальда, Севіджа, Гурвіца).
19. Правила прийняття рішень з використанням кількісних значень імовірнісних ісходів (правило максимінної ймовірності, оптимізація математичного сподівання).
20. Аналіз ризику для інвестиційних програм.

21. Концепція корисності фон Неймана-Моргенштерна.
22. Формалізація моделі прийняття рішень в умовах ризику.
23. Переважливість на множині результатів та її відображення за допомогою функції корисності.
24. Приклади функцій корисності.
25. Переважливість на множині ймовірнісних розподілів.
26. Лотерея та її детермінований еквівалент. Премія за ризик.
27. Ставлення особи, що приймає рішення до ризику: схильність, несхильність. байдужість.
28. Сподівана корисність. Криві байдужості.
29. Деякі відомі функції корисності.
30. Математична модель клієнта страхової компанії.
31. Ймовірність страхового випадку та реакція клієнта страхової компанії.
32. Прибуток страхової компанії та його корисність.
33. Модель страхової компанії нейтральної до ризику.
34. Параметричний аналіз взаємодії страхової компанії та її клієнта.
35. Страхування ризику.
36. Розподіл ризику.
37. Об'єднання ризику.
38. Диверсифікація та хеджування ризику.
39. Зниження ризику шляхом збору додаткової інформації.
40. Основні поняття теорії прогнозування фінансових показників.
41. Синтез методики прогнозування курсу цінних паперів.
42. Прогнозування із застосуванням методів апроксимації.
43. Прогнозування із застосуванням методів нейронних мереж.
44. Проведення комп'ютерних експериментів.