ПИТАННЯ ДО ЗАЛІКУ

з дисципліни «Управління ризиком»

1. Сутність ризику як економічної категорії, його основні елементи та риси
2. Загальні проблеми. Головні цілі менеджменту та ризик.
3. Основні риси та функції ризику.
4. Характеристика підприємницьких ризиків.
5. Невизначеність як риса ризику.
6. Організаційні методи нейтралізації економічного ризику.
7. Управління діловим ризиком.
8. Управління фінансовим ризиком на підприємстві
9. Основні принципи управління ризиком. Етапи управління ризиком.
10. Ризик-позиція підприємства та особливості її прояву.
11. Сутність управління економічними ризиками.
12. Стратегія і тактика управління економічними ризиками.
13. Зміст процесу управління фінансовими ризиками.
14. Прийняття рішень в умовах невизначеності
15. Показники допустимого, критичного і катастрофічного ризику.
16. Систематичний і несистематичний ризик. Коефіцієнт чутливості бета (β), його сутність та визначення.
17. Характеристика експертних процедур аналізу ризику , їх переваги та недоліки.
18. Класична модель формування портфеля цінних паперів.
19. Модель рівноваги ринку капіталів (САРМ).
20. Оцінка ринкової вартості підприємства та ризик.
21. Теорія портфеля цінних паперів (активів) і його оптимізація.
22. Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.
23. Управління запасами з урахуванням ризику.
24. Мета і завдання розробки програми управління ризиками.
25. Інформаційне забезпечення розробки програми управління ризиком.
26. Прийняття управлінського рішення на засадах оптимального планування.
27. Метод побудови дерева рішень в управлінні ризиками.