ТЕМАТИКА РЕФЕРАТІВ

(Презентацій)

з дисципліни «Економічний ризик та його вимірювання»

1. Сутність та необхідність управління економічним ризиком.
2. Систематичний та несистематичний ризик. Коефіцієнт бета, його сутність та застосування.
3. Концепція оцінки фінансового ризику «вартість під ризиком» (VaR). Методи оцінки VaR.
4. Індивідуальні та групові аномалії в економічній поведінці й ризик.
5. Оцінка фактора ліквідності в процесі управління фінансовими ризиками
6. Прийняття рішень в умовах ризику. Функція корисності Неймана-Монгерштерна.
7. Прийняття рішень в умовах невизначеності..
8. Формування корпоративної культури ризику.
9. Управління діловим ризиком.
10. Міра неприйняття ризику Ерроу-Пратта. Парадокс Алле.
11. Теорія перспектив Канемана-Тверскі. Ефекти ризикованого вибору
12. Фреймінг. Залежність вибору від контексту. Види фреймів.
13. Евристика доступності. Евристики оцінки частоти та вірогідності.
14. Аномалії ринкової поведінки. Пастка дивідендів.
15. Модель САРМ. Лінія ринку капіталу.
16. Формування портфеля цінних паперів з урахуванням ризику.

**Рекомендована література**

Основна

1. Балджи М. Д. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навч. посібник. Харьків: Промарт, 2015. 300 с.
2. Васильєва Т. А., Лєонов С. В., Кривич Я. М. Економічний ризик: методи оцінки та управління: навч. посібник; під заг. ред. д-ра екон. наук, проф. Т. А. Васильєвої, канд. екон. наук Я. М. Кривич. Суми: ДВНЗ “УАБС НБУ”, 2015. 208 с.
3. Гранатуров В. М., Шевчук О. Б. Ризики підприємницької діяльності: Проблеми аналізу. Київ: Зв'язок, 2020. 152 с.
4. Посохов І. М. Управління ризиками у підприємництві: навч посібник Харків : НТУ «ХПІ», 2015. 220 c.
5. Череп А. В., Кущик А. П. Економічний ризик та його оцінка: підручник. Запоріжжя: ФОП Мокшанов В. В. 2022. 316 с.

Додаткова

1. Абрамова О. Методика експертної оцінки варіантів проектів прийняття рішень. *Укр. ін вест. журн. Welcome*. 2014. № 12. С. 33-45.
2. Андреєва Г. Є., Петровська Г. Е. Ризик у ринковій економіці: навч. посібник. Харків: Бурун Книга, 2005.
3. Андрейчикова А. Н. Неопределенность как источник возникновения риска зкономической деятельности. *Академ. огляд.* 2017. № 1. С. 71-75.
4. Гуменюк В.Я., Міщук Г.Ю., Олійник О.О. Управління ризиками : навч. посіб.; Нац. ун-т вод. госп-ва та природокористування. Рівне : НУВГП, 2010. 158 с.
5. Канеман Даниэль. Думай медленно... решай быстро. Москва: АСТ, 2014. 653 с.
6. Кігель В. Методи і моделі підтримки прийняття рішень у ринковій економіці: монографія. Київ: ЦУЛ, 2018. 202 с.
7. Кущик А. П. Управління фінансовими ризиками: конспект лекцій. Запоріжжя: ЗНУ, 2016. 109 с.
8. Овчинников І.О. Технологія оцінки ризиків в процесі управління ризиками на прикладі методу VAR. Электрон. дан. Інститут економіки та менеджменту: електронне наукове фахове видання. 2017. 213 с. URL: www.nbuv.gov.ua/e-journals/PSPE/2007-1/index.html.
9. Хіт Роберт. Кризовий менеджмент для керівників: пер. с англ. Київ: Всеувито; Наук, думка, 2002. 566 с.
10. Ястремський О. І. Моделювання економічного ризику. Київ: Либідь, 2012. 176 с.
11. Crouhy M. Galai D. Risk management. Mark. McGraw-Hill, 2011. 717 p.
12. Kushchik A. P. Diagnostics and substantiation of competitive advantages of commercial bank. *Вісник Запоріз. Нац. універ: Зб. наукових праць. Економічні науки.* №1 (45) Запоріжжя: ЗНУ, 2020. С.30-35.