ТЕМИ

практичних занять з дисципліни «Економічний ризик та його оцінка»

***Тема 1.*** *РИЗИК ТА ЙОГО ХАРАКТЕРИСТИКИ*

1. Поняття ризику і ризикової ситуації.
2. Сутність економічного ризику та його риси – суперечливість, альтернативність, невизначеність.
3. Види ризиків. Класифікація ризиків за певними ознаками.
4. Причини та джерела виникнення фінансового ризику.

***Тема 2.*** *ТЕОРЕТИЧНІ ОСНОВИ ОЦІНЮВАННЯ ЕКОНОМІЧНОГО РИЗИКУ*

1. Якісний і кількісний аналіз. Етапи і послідовність аналізу ризику.
2. Зони та рівні ризику.
3. Взаємозв’язок прибутку і ризику.
4. Методи оцінювання ризику. Статистичні методи, їх складові.
5. Метод аналізу доцільності витрат.
6. Метод експертного оцінювання.
7. Оцінювання систематичного ризику.

***Тема 3.*** НЕВИЗНАЧЕНІСТЬ ТА РИЗИК

1. Поняття невизначеності. Повна та часткова невизначеність.
2. Типи невизначеності
3. Невизначеність та ймовірність.
4. Основні причини невизначеності. Чинники невизначеності.

***Тема 4.*** *МЕТОДИ ОПТИМІЗАЦІЇ ЕКОНОМІЧНИХ РИЗИКІВ*

1. Способи впливу на ризик: зниження, збереження, передача ризику.
2. Організаційні методи зниження ризику.
3. Економічні методи зниження ризику.
4. Створення резерву і страхового запасу.
5. Страхування і самострахування від ризику.
6. Геджування ризику.

***Тема 5.*** *РИЗИК ТА ЕЛЕМЕНТИ ТЕОРІЇ КОРИСНОСТІ*

1. Теорія очікуваної (лінійної) корисності.
2. Ставленням до ризику. Оцінка рішень з врахуванням суб’єктивного відношення до ризику.
3. Суб’єктивні ризикові переваги і «крива байдужості». Некласичні ймовірності та нерівність Чебишева.
4. Модель прийняття ризикових рішень і функція корисності Неймана-Монгерштерна.
5. Плата за ризик. Винагорода за ризик.

***Тема 6.*** *ОСНОВИ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ*

1. Поняття ризик-менеджменту. Розвиток концепції ризик-менеджменту.
2. Характеристика ризик-менеджменту як різновиду управлінської діяльності.
3. Міжнародні стандарти ризик-менеджменту.
4. Етапи та організація ризик-менеджменту.
5. Стратегічний ризик-менеджмент підприємницької та інвестиційної діяльності.

***Тема 7.*** *СИСТЕМА УПРАВЛІННЯ ЕКОНОМІЧНИМ РИЗИКОМ*

1. Формування стратегії управління ризиком.
2. Система управління ризиком.
3. Система інформаційного забезпечення управління економічними ризиками підприємства.
4. Принципи прийняття управлінських рішень.
5. Оцінка варіантів управлінських рішень з урахуванням ризику.
6. Метод побудови дерева рішень.

***Тема 8.*** *ТЕОРІЯ ІГОР ТА УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ.*

1. Основи теорії ігор і ризики. Конфліктні ситуації в економіці.
2. Основні елементи прийняття рішень невизначеності та ризику. Множина станів економічного середовища. Послідовність прийняття рішень.
3. Застосування методів теорії ігор у ризик-менеджменті.
4. Прийняття рішень в умовах невизначеності.
5. Вибір оптимального ризикового рішення за критерієм Вальда.
6. Критерії максимакса, Гурвіца, Севіджа.
7. Прийняття рішення для декількох матриць оцінювання.

***Тема 9.*** ІНСТРУМЕНТАРІЙ УПРАВЛІННЯ ФІНАНСОВИМИ РИЗИКАМИ

1. Систематичний та несистематичний ризик.
2. Коефіцієнт бета, його сутність та застосування. Модель окупності капітальних активів (МОКА).
3. Концепція оцінки фінансового ризику «вартість під ризиком» ( VaR ). Методи оцінки VaR.
4. Оцінка фактора ліквідності в процесі управління фінансовими ризиками.
5. Особливості управління ризиками в операційній діяльності підприємства.

***Тема 10.*** *ОЦІНКА РИЗИКУ ПОРТФЕЛЯ ЦІННИХ ПАПЕРІВ*

1. Портфель цінних паперів, його структура.
2. Показники ризикових цінних паперів: сподівана ефективність (нормою прибутку) і ступень ризику (варіацією, дисперсією).
3. Управління портфелем цінних паперів.
4. Оптимізація пакету з двох різних видів акцій. Портфель з багатьох акцій.
5. Спрощена класична модель формування портфеля. Лінії цінного паперу.
6. Формування портфеля цінних паперів з урахуванням ризику.
7. Оптимізація структури портфеля цінних паперів.