ПИТАННЯ ДО ЗАЛІКУ

з дисципліни «Економічний ризик та його оцінка»

1. **Сутність ризику як економічної категорії, його основні елементи та риси**
2. **Основні причини виникнення економічного ризику.**
3. **Загальні принципи класифікації ризиків.**
4. **Принципи аналізу ризику. Якісний аналіз ризику.**
5. **Сутність кількісного аналізу ризику.**
6. **Існуючі методи кількісного аналізу ризику (статичний, метод аналогів, експертний).**
7. **Основні риси та функції ризику.**
8. **Характеристика особливості кожної зони (області) ризику.**
9. **Ризик у ринковій економіці (динамічний, статичний).**
10. **Валютний ризик та його основні види.**
11. **Характеристика підприємницьких ризиків.**
12. **Умови доцільності використання методу експертних оцінювань.**
13. **Поняття економічного сенсу невизначеності.**
14. **Невизначеність як риса ризику.**
15. **Організаційні методи нейтралізації економічного ризику.**
16. **Економічні методи нейтралізації ризику.**
17. **Диверсифікація як засіб нейтралізації економічного ризику.**
18. **Основні принципи управління ризиком. Етапи управління ризиком.**
19. **Ризик-позиція підприємства та особливості її прояву.**
20. **Сутність управління економічними ризиками.**
21. **Стратегія і тактика управління економічними ризиками.**
22. **Зміст процесу управління фінансовими ризиками.**
23. **Загально-методичні підходи до кількісної оцінки ризику.**
24. **Характеристика основних інструментів статистичного методу розрахунку ризику.**
25. **Визначення ризику у абсолютному виразі.**
26. **Визначення ризику у відносному виразі..**
27. **Показники допустимого, критичного і катастрофічного ризику.**
28. **Оцінка ризику ліквідності. Коефіцієнти ліквідності та порядок їх визначення.**
29. **Шкали ризику та характеристика їх градації.**
30. **Систематичний і несистематичний ризик. Коефіцієнт чутливості бета (β), його сутність та визначення.**
31. **Характеристика експертних процедур аналізу ризику , їх переваги та недоліки.**
32. **Загальна схема експертизи та підбір експертів.**
33. **Аналіз і обробка експертних оцінок.**
34. **Класична модель формування портфеля цінних паперів.**
35. **Урахування ризику при інвестуванні капітальних вкладень.**
36. **Модель рівноваги ринку капіталів (САРМ).**
37. **Оцінка ринкової вартості підприємства та ризик.**
38. **Теорія портфеля цінних паперів (активів) і його оптимізація.**
39. **Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику. Основні показники та їх розрахунок.**
40. **Принципи формування інвестиційного портфеля з урахуванням ризику.**
41. **Вибір методів зниження економічного ризику.**
42. **Основні методи зниження економічного ризику та їх характеристика. (страхування, резервування коштів, лімітування).**
43. **Вибір методів зниження економічного ризику (суперпозиція способів зниження ризику).**
44. **Створення резерву грошових засобів на покриття випадкових витрат.**
45. **Управління запасами з урахуванням ризику.**
46. **Мета і завдання розробки програми управління ризиками.**
47. **Інформаційне забезпечення розробки програми управління ризиком.**
48. **Прийняття управлінського рішення на засадах оптимального планування.**
49. **Метод побудови дерева рішень в управлінні ризиками.**