ТЕМИ ПРАКТИЧНИХ ЗАНЯТЬ

З ДИСЦИПЛІНИ «УПРАВЛІННЯ РИЗИКОМ»

***Тема 1.*** *МЕТОДОЛОГІЧНІ ОСНОВИ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ*

1. Поняття ризику і ризикової ситуації.
2. Методи оцінювання ризику. Індикатори рівня ризику.
3. Поняття асиметрії інформації.
4. Невизначеність і ризик. Раціональний та ірраціональний підхід.
5. Теорія хаосу й ризик. Психологія ризику. Філософія ризику.
6. Поняття ризик-менеджменту. Стандарти ризик-менеджменту.
7. Методи мінімізації ризиків. Диверсифікація ризику. Концепція прийнятного ризику.

***Тема 2.****МЕТОДИЧНИЙ ІНСТРУМЕНТАРІЙ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ*

1. Систематичний та несистематичний ризик. Коефіцієнт бета, його сутність та застосування.
2. 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.
6. Управління ризиками в інвестиційній діяльності підприємства.

***Тема 3.*** *ОБҐРУНТУВАННЯ УПРАВЛІНСЬКИХ РІШЕНЬ В УМОВАХ РИЗИКУ*

1. Основи теорії прийняття рішень.
2. Теорія очікуваної (лінійної) корисності. 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. Побудова «матриці рішень».
4. Прийняття рішень в умовах ризику. Функція корисності Неймана-Монгерштерна.
5. Прийняття рішень в умовах невизначеності..
6. Формування корпоративної культури ризику.
7. Управління діловим ризиком.

***Тема 4.*** *УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ ПОРТФЕЛЯ ЦІННИХ ПАПЕРІВ*

1. Загальні засади теорії портфеля.
2. Комбінації «доходність/ризик» портфеля. Визначення ризику портфеля інвестицій.
3. Модель САРМ. Лінія ринку капіталу. Ефект диверсифікації.
4. Формування портфеля цінних паперів з урахуванням ризику.
5. Оптимізація структури портфеля цінних паперів.