

ПИТАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОГО ОПРАЦЮВАННЯ ЗА ЗМІСТОВНИМ МОДУЛЕМ 2

Методологічні основи управління економічними ризиками

1. Назвіть та опишіть основні кількісні та якісні методи оцінки економічного ризику.
2. Які етапи включає в себе процес управління ризиками? Опишіть кожен з них.
3. Поясніть, що таке «ризик-менеджмент» і чому він є невід'ємною частиною сучасного бізнесу.
4. Що таке «портфельна теорія» і для чого вона використовується? Назвіть її ключових авторів.
5. Як кореляція між активами впливає на загальний ризик інвестиційного портфеля? Наведіть приклад.
6. Поясніть поняття «ефективного портфеля» за Марковіцем.
7. Що таке «диверсифікація» і як вона допомагає мінімізувати ризик? Наведіть приклади диверсифікації в реальному житті.
8. Які існують стратегії реагування на ризик (уникнення, прийняття, зниження, передача)? Поясніть кожен з них.
9. Чим відрізняються поняття «системний ризик» та «несистемний ризик»? Як їх можна оцінити?
10. Як виміряти ефективність управління ризиками в компанії? Запропонуйте конкретні показники.