

### **Питання з «Економічний ризик і методи його вимірювання»**

1. Поняття ризику.
2. Види ризику.
3. Ризик і прибуток.
4. Числові характеристики ризику в абсолютному та відносному виразі.
5. Ризик та нерівність Чебишева.
6. Поняття про корисність. Побудова функції корисності.
7. Корисність за Нейманом, числові характеристики ризику з врахуванням функцій корисності.
8. Різне ставлення до ризику та корисність. Криві байдужості.
9. Інформаційні ситуації ступенів градації невизначеності.
10. Критерії прийняття рішень при заданому розподілі імовірностей станів середовища.
11. Критерії прийняття рішень у 2-й та 3-й інформаційних ситуаціях.
12. Критерії прийняття рішень в ситуації, що характеризується антагоністичними інтересами середовища.
13. Шоста інформаційна ситуація.
14. Методи зведення багатокритеріальних задач до задач з одним критерієм прийняття рішення.
15. Методи нормалізації функціоналів оцінювання.
16. Структурна схема процесу побудови моделей багатокритеріальних задач.
17. Класи задач прийняття багатоцільових рішень за умов невизначеності і ризику.
18. Класифікація задач стохастичного програмування.
19. Однопродуктова задача управління виробництвом.
20. Задачі стохастичного програмування з ризиком невиконання обмежень задачі.
21. Сутність диверсифікації.
22. Норма прибутку та ризик цінних паперів.
23. Оптимізація портфеля з багатьох видів акцій.
24. Спрощена класична модель формування портфеля.
25. Модель рівноваги капіталів.
26. Техніка дисконтування.
27. Майбутня і теперішня вартість.
28. Основні зони ризику. Допустимий, критичний та катастрофічний ризику. Побудова кривої ризику.
29. Вимірювання ризику та система антиризикових заходів.
30. Основні принципи розробки інвестиційної стратегії з урахуванням ризику. Методи оцінки інвестиційних проектів з урахуванням ризику.
31. Структура та види запасів, резерв на непередбачені витрати.
32. Управління запасами з урахуванням ризику.

## **ОСНОВНА ЛІТЕРАТУРА**

1. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик в менеджменті. Київ: Борисфен, 1996.
2. Штефанич Д.А., Вашків В.Г., Попіна С.Ю. “Підприємницький ризик: суть, оцінка та шляхи попередження”. Тернопіль, Астон, 1995.
3. Програма, методичні вказівки та навчальні завдання для проведення практичних занять і лабораторних робіт з курсу “Економічний ризик і методи його вимірювання”. К., КДЕУ, 1995.
4. Івашук О.Т. “Математичні методи та моделі в управлінні виробництвом”.
5. Вітлінський В.В., Верченко П.І., Сігал А.В., Наконечний Я.С. Економічний ризик: ігрові моделі. – К.:КНЕУ, 2002.
6. Навчальний матеріал з курсу “Економічний ризик і методи його вимірювання” для студентів економічних спеціальностей. – Тернопіль, 2001.
7. Управління підприємницьким ризиком. (За загальною редакцією проф. Д.А.Штефанича). Тернопіль, Економічна думка, 1999.
8. Вітлінський В.В., Наконечний С.І., Шарапов О.Д. Економічний ризик і методи його вимірювання. Київ:, 1996.
9. Івченко І.Ю. Економічні ризики: Навчальний посібник. – Київ: “Центр навчальної літератури”, 2004. –304с.
10. Машина Н.І. Економічний ризик та методи його вимірювання. Навчальний посібник. – Київ: “Центр навчальної літератури”, 2003. –188с.
11. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2000. –292с.