

Питання по дисципліні "«Управління ризиками в інноваційній діяльності»"

1. Визначення економічного ризику (в класичному розумінні).
2. Визначення економічного ризику (в широкому розумінні).
3. Умови виникнення економічного ризику.
4. Суть невизначеності як умови виникнення економічного ризику.
5. Основні причини загострення економічного ризику у сучасній економічній діяльності.
6. Приклади економічних рішень, пов'язаних з підвищеним ризиком.
7. Характеристика венчурного бізнесу.
8. Об'єкт економічного ризику.
9. Суб'єкт економічного ризику.
10. Джерело економічного ризику.
11. Класифікація ризиків за джерелами виникнення.
12. Характеристика систематичного (ринкового) ризику.
13. Характеристика несистематичного (специфічного) ризику.
14. Види ризиків за сферами прояву.
15. Характеристика політичного та економічного ризиків.
16. Характеристика соціального та екологічного ризиків.
17. Види підприємницького ризику.
18. Види фінансового ризику.
19. Характеристика виробничого ризику.
20. Характеристика фінансового ризику.
21. Характеристика інвестиційного ризику.
22. Характеристика ризику зміни відсоткової ставки.
23. Характеристика ризику невикористаних можливостей чи втраченої вигоди.
24. Характеристика ризику втраченої вигоди.
25. Суть форс-мажорних обставин як джерела ризиків.
26. Суть поняття "володіння" ризиком.
27. Характеристика ризику ліквідності активів.
28. Класифікація активів за часом трансформації в грошову форму.
29. Класифікація активів за величиною збитків, які виникають при трансформації цих активів у грошову форму.
30. Збитки, які виникають при трансформації активів у грошову форму.
31. Суть крайнього ризику.
32. Суть галузевого ризику.
33. Блок-схема процесу аналізу економічного ризику.
34. Підходи до аналізу ризику.
35. Суть якісного аналізу ризику.
36. Суть кількісного аналізу ризику.
37. Методи кількісного вимірювання величини ризику.
38. Об'єктивні і суб'єктивні методи вимірювання економічного ризику.
39. Показники економічного ризику в абсолютному виразі.

40. Суть ймовірності як показника ризику.
41. Формула визначення ймовірності як показника ризику статистичним методом.
42. В якому проміжку знаходяться значення показника ймовірності настання ризику.
43. Формула визначення величини можливих збитків.
44. Формула визначення середньоквадратичного відхилення від сподіваної середньої величини.
45. Формула математичного сподівання випадкової величини.
46. Формула дисперсії випадкової величини.
47. Оцінка економічного ризику за величиною показників ризику в абсолютному виразі
48. Необхідність визначення показників ризику у відносному виразі.
49. Показники економічного ризику у відносному виразі.
50. Формула визначення коефіцієнта ризику як показника у відносному виразі.
51. Формула визначення коефіцієнта варіації як показника у відносному виразі.
52. Який з показників ризику у відносному виразі застосовується, коли оцінюється ризик банкрутства.
53. Оцінка економічного ризику за величиною показників ризику у відносному виразі.
54. Значення коефіцієнта ризику дорівнює 1, що це означає?
55. Чи може коефіцієнт ризику набувати значень більше 1, що означає така ситуація?
56. Суть показника ризику β .
57. Який вид ризику за джерелами виникнення характеризує β .
58. Значення β ринкового портфеля цінних паперів (усередненої ринкової акції).
59. Гранична величина ймовірності ризику збитків, встановлена експертами, для інвестицій з допустимим ступенем ризику.
60. Гранична величина ймовірності ризику збитків, встановлена експертами, для інвестицій з критичним ступенем ризику.
61. Гранична величина ймовірності ризику збитків, встановлена експертами, для інвестицій з катастрофічним ступенем ризику.
62. Умова уникнення банкрутства за нерівністю Чебишева, коли для підприємницької діяльності залучається кредит.
63. Умова уникнення банкрутства за нерівністю Чебишева, коли для підприємницької діяльності використовується власний капітал.
64. Які зони економічного ризику для підприємницької діяльності виділяють?
65. Характеристика зони допустимого ризику.
66. Характеристика зони критичного ризику.
67. Характеристика зони катастрофічного ризику.
68. Можливі втрати в зоні допустимого ризику.
69. Можливі втрати в зоні критичного ризику.
70. Можливі втрати в зоні катастрофічного ризику.

71. Характеристика особи несхильної до ризику.
72. Характеристика особи схильної до ризику.
73. Характеристика особи байдужої до ризику.
74. Активна тактика поводження суб'єктів ризику у ризикованих ситуаціях.
75. Пасивна тактика поводження суб'єктів ризику у ризикованих ситуаціях.
76. Характеристика ситуації гри.
77. Суть терміну “критерій прийняття рішень” у ситуаціях з ризиком.
78. Оцінка ризикованих ситуацій за критерієм Байєса.
79. Оцінка ризикованих ситуацій за критерієм Вальда.
80. Оцінка ризикованих ситуацій за критерієм Севіджа.
81. Суть матриці ризику.
82. Формула для побудови матриці ризику.
83. Оцінити загалом, які цінні папери є більш ризикованими: державні облігації, облігації підприємств, акції?
84. Облігація є безпечним чи ризикованим цінним папером?
85. Критерії оцінки привабливості цінних паперів, інвестиційних проектів та загалом економічних рішень
86. Норма прибутку акцій, формула для визначення.
87. Формула математичного сподівання прибутку акції, виходячи з статистичної бази за минулі періоди.
88. Формула середньоквадратичного відхилення прибутку акції від сподіваної середньої величини, виходячи з статистичної бази за минулі періоди.
89. Формула дисперсії прибутку акції, виходячи з статистичної бази за минулі періоди.
90. Характеристика коефіцієнта β для звичайної акції.
91. Класифікація β для звичайної акції.
92. Значення β для захищеної акції.
93. Значення β для агресивної акції.
94. Значення β для дифенсивної акції.
95. Суть диверсифікації.
96. Види диверсифікації.
97. Суть розсудливої диверсифікації.
98. Наївна диверсифікація.
99. Поняття портфеля цінних паперів.
100. Структура портфеля цінних паперів.
101. Основне прагнення при формуванні портфеля цінних паперів.
102. Формула сподіваної норми прибутку портфеля з 2-х акцій.
103. Формула дисперсії, як показника ризику, портфеля з 2-х акцій.
104. Суть коефіцієнта кореляції для 2-х акцій.
105. Рисунок множини портфелів 2-х додатньокорельованих акцій.
106. Чи привабливим для інвестора є формування портфелів з 2-х додатньокорельованих акцій?
107. Рисунок множини портфелів 2-х некорельованих акцій.
108. Чи привабливим для інвестора є формування портфелів з 2-х некорельованих акцій.

109. Рисунок множини портфелів 2-х оберненокорельованих акцій.
110. Чи привабливим для інвестора є формування портфелів з 2-х оберненокорельованих акцій.
111. Визначення ефективних портфелів з множини допустимих.
112. Мета формування оптимального портфеля цінних паперів.
113. Формула лінії ринку капіталів (ринкової доходності цінного паперу).
114. Загальне правило для інвестора, який прагне сформувати оптимальний портфель цінних паперів.
115. Для того, щоб портфель цінних паперів був досить надійним, вважається за необхідне сформувати його з:
116. Оптимальний портфель цінних паперів: принцип формування, щонайменша кількість акцій, які слід залучити.
117. Формування оптимального портфеля цінних паперів за коефіцієнтом кореляції, за коефіцієнтом β .
118. Чи доцільно залучати до портфеля цінних паперів частину дифенсивних акцій.
119. Чи доцільно залучати до портфеля цінних паперів частину агресивних акцій.
120. Правило визначення надійності портфеля цінних паперів.
121. Ризик та вартість у часі.
122. Формула розрахунку майбутньої вартості теперішніх надходжень.
123. Формула приведення майбутньої вартості до теперішньої.
124. Визначення норми дисконту.
125. Основні принципи оцінювання дисконтних ставок у залежності від ризику.
126. Як впливають високий ризик та інфляція на величину норми дисконту?
127. Яке з майбутніх надходжень має вищу дисконтну ставку?
128. Якщо сподіваний рівень ризику на ринку знижується, то ставка дисконту: а) знижується; б) підвищується; в) залишається незмінною?
129. Визначення кредитного ризику.
130. Формула відсоткових ставок за кредит з урахуванням ризику (складові).
131. Заходи банківських установ щодо убезпечення від кредитного ризику.
132. Визначення валютного ризику.
133. Види валютного ризику.
134. Суть операційного валютного ризику.
135. Суть трансляційного валютного ризику.
136. Суть економічного валютного ризику.
137. Сутність хеджування валютного ризику.
138. Основні методи управління валютним ризиком. Основні фінансові інструменти, які використовуються для зниження валютного ризику.
139. Основні принципи управління економічним ризиком.
140. Узагальнена блок-схема процесу управління економічним ризиком.

141. Типи ризик-менеджменту: прийняття ризику, уникання, його попередження.
142. Дисипація як спосіб зниження ризику:
143. Внутрішні способи зниження ризику.
144. Зовнішні способи оптимізації економічного ризику.
145. Види економічного ризику аграрного виробництва.
146. Ризики в Україні на нинішньому етапі.
147. Розкрити високу ризикованість венчурного бізнесу.
148. Поняття економічної системи і її основні ознаки.
149. Що таке невизначеність, її типи.
150. Визначення терміну „рішення”, перерахувати цілі та потреби у прийнятті господарських рішень.
151. Класифікація видів рішень.
152. Охарактеризувати процес прийняття рішень, його складові.
153. Суть і важливість розробки альтернатив при прийнятті рішень.
154. Навести обставини, які ускладнюють прийняття раціональних господарських рішень.
155. Основні моделі прийняття рішень, їх особливості й чинники, які зумовлюють їх вибір.
156. Спрощена модель раціональної технології прийняття рішення.
157. Особливості прийняття господарських рішень в сільському господарстві, чинники, які їх зумовлюють.
158. Особливості прийняття рішень в інноваційній сфері.
159. Класифікація ризиків інноваційної діяльності в аграрному секторі.
160. Як ураховуються ризики при формуванні стратегій управління.
161. Визначення корпоративної культури, її формування у відповідності до стратегічних цілей.
162. Заходи і важелі підтримки інноваційної діяльності на підприємстві.
163. Класифікація видів економічної діяльності за рівнем професійного ризику.