Студент обирає тему дослідження та проводить дослідження під кураторством викладача дисципліни  – індивідуальна робота*.*

***Теми дослідження***наводяться нижче:

1. Якісний аналіз та класифікація банківських ризиків.
2. Сутність та причини виникнення ризику в фінансовому менеджменті.
3. Інновації та ризик.
4. Ризик у зовнішньоекономічній діяльності підприємства.
5. Антикризове управління фірмою та ризик.
6. Аналіз ризику в агропромисловому комплексі (АПК).
7. Зовнішній борг України та ризик.
8. Застосування методу аналогій для кількісної оцінки ризику.
9. Використання методу аналізу чутливості для виявлення основних чинників ризику проекту.
10. Використання експертних методів для оцінки ризику проекту.
11. Використання статистичного методу для кількісної оцінки ризику.
12. Використання функцій щільності логарифмічно нормального та гама-розподілів для аналізу ризику збитків.
13. Моделі прогнозування валютних курсів та валютного ризику.
14. Моделі кількісного аналізу кредитного ризику комерційного банку.
15. Моделі кількісного аналізу ризиків у зовнішньо-економічній діяльності.
16. Використання абсолютних оцінок ризику при прийнятті фінансових (інвестиційних) рішень.
17. Використання відносних оцінок ризику при прийнятті управлінських рішень.
18. Новітні підходи щодо адекватного вимірювання ступеня політичного та країнного ризиків.
19. Використання експертних процедур при вимірюванні ступеня інвестиційних ризиків.
20. Лотереї з недискретними розподілами.
21. Системи аксіом прийняття рішень та теорії корисності.
22. Методи побудови функцій корисності та приклади їх реалізації.
23. Моделі портфельного підходу в теорії грошей з використанням функцій корисності.
24. Використання функцій несхильності до ризику під час прийняття рішень.
25. Теоретико-математичні моделі хеджування як засобу зниження ризику.
26. Ринки фінансових ф’ючерсів з метою зниження ступеня ризику.
27. Здобуття додаткової інформації як засіб зниження ступеня ризику. Відповідні економіко-математичні моделі.
28. Способи управління ризиком у банківській сфері.
29. Ризик у проблемах компромісного узгодження виробничої програми з оптимальною областю маневрування.
30. Резерви як метод зниження ризику страхових компаній.
31. Банківські резерви та ризик.
32. Методи антикризового управління компанією та роль резервів і запасів у цьому.
33. Моделювання раціонального узгодження виробничої програми з областю маневрування за рахунок запасів та резервів.
34. Запаси та резерви як методи зниження ризику реалізації інноваційних процесів.
35. Моделювання резервів у зовнішньоекономічній діяльності.
36. Валютні резерви як спосіб зниження економічних ризиків та методи їх моделювання.
37. Моделювання резервів в АПК.
38. Запаси та резерви, пов’язані з проблемами зниження ступеня ризику у торговельному підприємництві.
39. Формування портфеля цінних паперів (ПЦП) на основі використання семіваріації.
40. Формування ПЦП на основі використання коефіцієнтів варіації та семіваріації.
41. Формування ПЦП на основі використання коефіцієнта асиметрії та похідних від нього оцінок ризику.
42. Формування ПЦП на основі використання коефіцієнта ексцесу та похідних від нього оцінок ризику.
43. Арбітражна теорія портфеля.
44. Використання теорії портфеля під час створення запасів матеріалів на підприємстві.
45. Дослідіть структуру ПЦП щодо збереження капіталу у випадку, коли m1 > m2 та s1< s2.
46. Використання ієрархічних моделей у проблемах антикризового управління фірмою.
47. Ієрархічні моделі та їх використання при обранні інноваційних проектів з урахуванням ризику.
48. Застосування багатокритеріального підходу при аналізі кредитного ризику комерційного банку.