## Тема 3. Риск и доходность. Управление корпорационными

## рисками.

**Вопросы для обсуждения:**

1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков.
2. Способы оценки финансового риска.
3. Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков.
4. Сущность и содержание риск-менеджмента.
5. Подготовить следующие таблицы:

*Классификация рисков предприятия*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № п/п | Признак классификации | Виды рисков | Характеристика |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

*Способы оценки финансовых рисков предприятия*

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № п/п | Наименование способа | Характеристика |
|  |  |  |
|  |  |  |

**Рекомендуемая литература:**

1. Бланк И.А. Финансовый менеджмент: Учебный курс. - К.: Ника-центр, 1999.

2. Глухов В.В., Бахрамов Ю.М. Финансовый менеджмент / Учебное пособие - СПБ: Специальная литература. Санкт-Петербург, 2004.

3. Ковалев В.В. Введение в финансовый менеджмент. - М.: Финансы и статистика, 2000г

4. Крейнина М.Н. Финансовый менеджмент. - М.:ДИС, 2004.

5. Сапарова Б. Финансовый менеджмент.- Алматы,2008

**Контрольные вопросы:**

1. Что такое риск?
2. Как классифицируют риски?
3. Дайте понятие допустимого, критического, катастрофического рисков.
4. В чем суть статистического метода оценки уровня финансового риска? Дайте понятие и приведите расчетные формулы главных инструментов статистического метода расчета финансового риска: вариация, дисперсия и стандартное (среднеквадратическое) отклонение.
5. Перечислите приемы снижения степени риска.
6. Что такое диверсификация риска?
7. В чем заключается лимитирование рисков.
8. Дайте понятие самострахованию и хеджированию рисков.
9. Что такое риск-менеджмент?
10. Как могут быть классифицированы методы защиты от финансовых рисков?