

Балдин К.В., Воробьев С.Н.

Риск-менеджмент: Учебное пособие. — М.: Гардарики, 2005. — 285 с: ил.

В учебном пособии освещаются понятие и трансформация понятия риска в предпринимательстве, а также виды, источники и классификация рисков в экономике по видам деятельности. Рассмотрены задача выбора стратегии и тактики управления рисками и методы решения задачи идентификации и прогнозирования рисков. Достаточно подробно изложены методы управления стохастическими, природными и поведенческими рисками

Для студентов высших учебных заведений, обучающихся по экономическим специальностям

СОДЕРЖАНИЕ

Введение

1. Риск — неизбежный фактор предпринимательской деятельности

1.1. Анализ понятия риска в предпринимательстве

1.2. Факторы, определяющие степень риска экономической деятельности

1.3. Основы неоклассической теории рисков

1.4. Основные виды предпринимательской деятельности и их характеристика

1.5. Факторы, формирующие профиль рисков организации

Вопросы и задания

2. Риск-анализ основных видов экономической деятельности организации

2.1. Общая характеристика экономической деятельности организации

2.2. Риски производственной деятельности организации

2.3. Финансовые риски организации и их влияние на предпринимательство

2.4. Коммерческие и посреднические риски и их роль в предпринимательской деятельности

Вопросы и задания

3. Классификация рисков предпринимательской деятельности организации

3.1. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления

3.2. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов

Вопросы и задания

4. Риск-менеджмент в организации

4.1. Методологические основы управления рисками в экономике

4.2. Современные тенденции в выборе стратегии риск-менеджмента

4.3. Основы концепции адаптивного динамического управления рисками в экономике

Вопросы и задания

5. Стратегические основы управления рисками в организации

- 5.1. Интегрированный подход к структуре службы риск-менеджмента фирмы
- 5.2. Концептуальные и стратегические направления снижения риска
- 5.3. Современные требования к управлению рисками
- 5.4. Контроль и отчетность процесса управления рисками

Вопросы и задания

6. Задачи идентификации и прогнозирования рисков в предпринимательской деятельности

- 6.1. Анализ априорной информации о рискованной деятельности
- 6.2. Основные технологии исследования предпринимательских рисков
- 6.3. Технический анализ рынка ценных бумаг
- 6.4. Фундаментальный анализ фондового рынка

Вопросы и задания

7. Методы идентификации стохастических рисков

- 7.1. Математические методы определения вероятностей рискованных событий
- 7.2. Основные вероятностные распределения предпринимательских рисков
- 7.3. Статистический метод идентификации вероятностных рисков

Вопросы и задания

8. Методы и технологии идентификации поведенческих и природных рисков

- 8.1. Проблемы идентификации поведенческого риска
- 8.2. Методы и технологии измерения природных рисков

Вопросы и задания

Заключение

Литература