

Балдин К. В.

Риск-менеджмент: Учебное пособие / К. В. Балдин. — М.: Эксмо, 2006. — 368 с. — (Риск-менеджмент).

В учебном пособии рассмотрены методологические, организационные и технологические основы принятия управленческих решений в условиях риска. Предложены методы системного анализа и математического моделирования сложных рискованных ситуаций. Даны модели и методы разработки решений по управлению рисками в условиях конкуренции. Отдельная глава посвящена проблеме автоматизации интеллектуальной поддержки принятия управленческих решений.

Для студентов вузов, обучающихся по специальностям «Экономика» и «Менеджмент», а также сотрудников консалтинговых фирм и предпринимателей, занимающихся самостоятельной практикой системного анализа рисков и принятия решений в рискованных ситуациях.

Оглавление

ВВЕДЕНИЕ

ГЛАВА 1. ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ПРОЦЕССА РАЗРАБОТКИ УПРАВЛЕНЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ

- 1.1.Современные проблемы управления и разработки решений
- 1.2.Организационные основы разработки решений на основе системного анализа складывающейся обстановки
- 1.3.Модель проблемной ситуации

ГЛАВА 2. МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ПРОЦЕССА РАЗРАБОТКИ УПРАВЛЕНЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ В СЛОЖНЫХ СИТУАЦИЯХ

- 2.1.Содержание процесса обоснования решений
- 2.2.Содержание процесса принятия и контроллинг решений
- 2.3.Методология решения базовых задач обоснования решений

ГЛАВА 3. ФОРМИРОВАНИЕ МЕТОДОВ РАЗРАБОТКИ РЕШЕНИЙ ПО УПРАВЛЕНИЮ СТОХАСТИЧЕСКИМИ РИСКАМИ

- 3.1.Объективные критерии оценки стохастического риска
- 3.2.Субъективные критерии оценки стохастического риска
- 3.3.Использование математических моделей и методов для обоснования рискованных предпринимательских решений
- 3.4.Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой

ГЛАВА 4. МОДЕЛИ И МЕТОДЫ РАЗРАБОТКИ РЕШЕНИЙ ПО УПРАВЛЕНИЮ РИСКАМИ В УСЛОВИЯХ КОНКУРЕНЦИИ

- 4.1. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
- 4.2.Аналитическая оценка рисков на основе принципов альтернативной индивидуальной полезности, кооперирования и «справедливого дележа»

4.3. Модели оценки и управления рисками при проведении торгов и аукционов

4.4. Методы снижения предпринимательского риска на основе принципов «социальной справедливости»

ГЛАВА 5. ПРОБЛЕМЫ АНАЛИЗА И СНИЖЕНИЯ

ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИХ РИСКОВ НЕУСТАНОВЛЕННОЙ ПРИРОДЫ («ПРИРОДНЫХ»)

5.1. Стратегическое прогнозирование «природно-неопределенных» рискованных ситуаций

5.2. Классические и современные методы принятия управленческих решений в условиях «природного» риска

5.3. Повышение роли управления рисками при подборе персонала

ГЛАВА 6. КОНЦЕПЦИЯ ИНФОРМАЦИОННО-АНАЛИТИЧЕСКОГО

ОБЕСПЕЧЕНИЯ АВТОМАТИЗАЦИИ ПОДДЕРЖКИ ПРИНЯТИЯ УПРАВЛЕНЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ

6.1. Концептуальные основы автоматизации поддержки принятия управленческих решений

6.2. Организационные аспекты интеллектуальной поддержки управленческой деятельности

6.3. Особенности разработки и применения систем искусственного интеллекта

ЛИТЕРАТУРА