

Оглавление

Предисловие

1. Теоретические основы риска

1.1. Сущность риска, подходы к исследованию природы риска....

1.2. Теории риска

1.3. Случайные события и степень риска

1.4. Риск как вероятность нежелательных событий. Методы определения нежелательного исхода

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

2. Эволюция риска и его виды

2.1. Основные этапы накопления знаний и развитие науки о риске

2.2. Классификационная система рисков

2.3. Классификация экономических рисков конкретного предприятия

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

3. Введение в менеджмент риска

3.1. Неопределенность и риск

3.2. Риск как часть экономического процесса. Объективная и субъективная стороны риска

3.3. Экономический риск и его характеристика

3.4. Закон и принципы риск-менеджмента

3.5. Процессный подход к управлению рисками

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

4. Система управления рисками

4.1. Методические основы формирования системы управления рисками

4.2. Оптимизационный подход к построению системы управления рисками

4.3. Организация риск-менеджмента

4.4. Стратегия риск-менеджмента

4.5. Инструментарий риск-менеджмента

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

5. Оценка риска

5.1. Измерение величины риска. Критерии оценки риска

5.2. Статистический метод оценки риска

5.3. Метод экспертных оценок

5.4. Аналитический метод

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

6. Анализ и оценка последствий риска

6.1. Принципы и порядок анализа и оценки последствий риска

6.2. Функции и методы анализа последствий риска

6.3. Выбор и особенности применения методов анализа риска

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

7. Управление проектным риском

7.1. Выявление причин и факторов проектного риска

7.2. Формальное описание риска проекта

7.3. Анализ и оценка проектных рисков

7.4. Обоснование и выбор проекта в условиях неопределенности и риска

7.5. Зарубежный опыт управления проектным риском и развитие новых услуг

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

8. Банковские риски

8.1. Сущность и классификация банковских рисков

8.2. Методологические аспекты оценки и управления операционными

рисками коммерческих банков

8.3. Новые финансовые инструменты снижения банковского риска

8.4. Риски, связанные с применением деривативов

8.5. Зарубежный опыт управления банковскими рисками и его

применение в условиях экономики Республики Беларусь

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

9. Кредитный риск

9.1 Кредитные отношения в совокупности экономических отношений, связанных с движением стоимости. Формы кредита

9.2. Типы кредитного риска

9.3. Причины наступления банковских рисков и факторы кредитного риска

9.4. Управление банковским кредитным риском

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

10. Управление банковскими рисками на основе имитационного моделирования

10.1. Сущность имитационного моделирования. Формализация понятий и измерение риска

10.2. Построение модели управления рисками и ресурсами банка

10.3. Оценка риска на основе модели управления рисками и ресурсами банка

10.4. Технология и условия применения имитационных моделей

управления ресурсами и рисками

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

11. Профилактика риска и методы его снижения

11.1. Профилактика рисков управления

11.2. Методы снижения рисков

11.3. Установление оптимального уровня риска

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

- 12. Страхование как инструмент управления риском
 - 12.1. Сущность, содержание и функции страхования
 - 12.2. Виды страхования
 - 12.3. Организационная структура страхования
 - 12.4. Системы страховой ответственности и их применение
 - 12.5. Актуарные расчеты. Их сущность, содержание и задачи
 - 12.6. Организация страховой деятельности в Республике Беларусь

Вопросы для обсуждения

Задания для самостоятельной работы

Приложение. Положение о страховании экспортных рисков с поддержкой государства

Литература