

Содержание

ВВЕДЕНИЕ

ТЕМА 1. ОСНОВНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ ТЕОРИИ АНАЛИЗА ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ

1.1. Сущность риска и его основные черты. Соотношение «риск-доходность»

1.2. Экзогенные и эндогенные факторы неопределенности

1.3. Классификация рисков

1.4. Способы оценки финансовых рисков

1.5. Пути снижения финансовых рисков

Контрольные вопросы

ТЕМА 2. ПОКАЗАТЕЛИ ИЗМЕРЕНИЯ ОБЩЕГО РИСКА

2.1. Понятие вероятности

2.2. Случайные величины и законы их распределения

2.3. Среднее (ожидаемое) значение случайной величины

2.4. Дисперсия и стандартное отклонение случайной величины

Контрольные вопросы

ТЕМА 3. ФОРМИРОВАНИЕ И ОЦЕНКА РИСКА-ДОХОДНОСТИ ОПТИМАЛЬНОГО ПОРТФЕЛЯ

3.1. Ожидаемая доходность и риск портфеля

3.2. Эффективные портфели

3.3. Выбор оптимального портфеля

Контрольные вопросы

ТЕМА 4. АНАЛИЗ РИСКА И ДОХОДНОСТИ ФИНАНСОВЫХ АКТИВОВ

4.1. Модель оценки доходности финансовых активов: основные исходные предпосылки модели

4.2. Линия рынка капитала

4.3. Линия рынка ценных бумаг

4.4. Концепция (3-коэффициента

Контрольные вопросы

ТЕМА 5. МЕТОДЫ АНАЛИЗА ЕДИНИЧНОГО РИСКА ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ

5.1. Этапы составления бюджета капиталовложений

5.2. Методы оценки единичного риска проекта

5.2.1. Анализ чувствительности

5.2.2. Анализ сценариев

5.2.3. Имитационное моделирование методом Монте-Карло

5.2.4. Анализ дерева решений

Контрольные вопросы

ТЕМА 6. ОЦЕНКА ВНУТРИФИРМЕННОГО И РЫНОЧНОГО РИСКА

6.1. Внутрифирменный (корпорационный) риск

6.2. Рыночный риск

6.3. Взаимосвязь между значениями β -коэффициентов фирмы, отдельных активов и структурой капитала

6.4. Методы измерения рыночного риска

Контрольные вопросы

ТЕМА 7. УЧЕТ РИСКА И СТРУКТУРЫ КАПИТАЛА ПРИ ПРИНЯТИИ БЮДЖЕТА КАПИТАЛОВЛОЖЕНИЙ

7.1. Метод безрискового эквивалента

7.2. Метод скорректированной на риск ставки дисконта.,

Контрольные вопросы

ТЕСТЫ ДЛЯ ПРОГРАММИРОВАННОГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ СТУДЕНТОВ

Ответы к тестам

ЛИТЕРАТУРА