

Оглавление

Введение

Раздел I. Основы риск-менеджмента инвестиционного проекта

Глава 1. Введение в риск-менеджмент

1.1. Понятия «риск» и «неопределенность»

1.2. Управление риском: сущность и содержание

1.3. Концепции минимизации риска и приемлемого риска

1.4. Принятие решения в условиях риска

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 2. Инвестиционный проект как объект риск-менеджмента

2.1. Понятие «инвестиционный проект»

2.2. Классификация инвестиционных проектов

2.3. Жизненный цикл проекта

2.4. Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Раздел II. Методология риск-менеджмента инвестиционного проекта

Глава 3. Процедуры риск-менеджмента инвестиционных проектов

3.1. Этапы и организация риск-менеджмента инвестиционного проекта

3.2. Классификация проектных рисков

3.3. Согласование интересов участников проекта

3.4. Инструменты управления рисками

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 4. Сущность риск-анализа инвестиционного проекта. Инструменты идентификации проектных рисков

4.1. Сущность риск-анализа инвестиционного проекта

4.2. Инструменты риск-анализа

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 5. Инструменты качественного анализа проектных рисков

5.1. Сущность качественного анализа проектных рисков

5.2. Идентификация рисков

5.3. Оценка вероятности неблагоприятных событий

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 6. Методы количественного риск-анализа инвестиционного проекта

6.1. Предварительные замечания

6.2. Анализ чувствительности проекта

6.3. Сценарный подход

6.4. Имитационное моделирование

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 7. Экономико-математическое моделирование в управлении проектными рисками

7.1. Экономико-математические модели для управления проектными рисками

7.2. Модели оценки эффективности инвестиционных проектов с учетом рисков

7.3. Применение имитационного моделирования

7.4. Вероятностная имитационная модель управления риском инвестиционного проекта

7.5. Оптимизация методов управления рисками

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 8. Компьютерный инструментарий проектного риск-менеджмента

- 8.1.Предпосылки информационных технологий проектного риск-менеджмента
- 8.2.Функциональные и обеспечивающие подсистемы информационных систем проектного риск-менеджмента
- 8.3.Типология информационных технологий управления проектными рисками
- 8.4.Компьютерная поддержка управления рисками на предынвестиционных фазах проекта
- 8.5.Составление сетевого плана
- 8.6.Технологии PERT, EPM и ERP в управлении рисками на этапе мониторинга выполнения проекта
- 8.7. Риски информационных технологий

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Раздел III. Аудит в управлении инвестиционным проектом

Глава 9. Аудит в риск-менеджменте инвестиционного проекта

9.1.Аудит: сущность, стандарты, виды

9.2.Аудит в риск-менеджменте инвестиционного проекта

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 10. Аудит на разных стадиях управления проектом

10.1.Предынвестиционная стадия

10.2.Стадия инвестирования

10.3.Стадия эксплуатации

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Раздел IV. Новые подходы в риск-менеджменте инвестиционных проектов

Глава 11. Теория планирования эксперимента в риск-менеджменте

11.1. Основы теории планирования эксперимента

11.2. Методы планирования эксперимента в риск-менеджменте

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 12. Концепция риска как ресурса

12.1. Ресурсно-подобные риски

12.2. Управление риском как ресурсом в ходе формирования
инвестиционного портфеля

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 13. Методы нечеткой математики в риск-менеджменте
инвестиционных проектов

13.1. Подходы нечеткой математики в риск-анализе

13.2. Модель оценки эффективности инвестиционного проекта с
применением теории нечетких множеств

13.3. Лингвистическая оценка риска. Расчет величины непредвиденных
расходов инвестиционного проекта

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 14. Управление риском инвестиционных проектов на основе метода
анализа иерархий

14.1. Анализ иерархических систем в задачах риск-анализа

14.2. Модель экспертной пофакторной корректировки денежного
потока инвестиционного проекта

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 15. Реальные опционы

15.1. Реальные опционы: определение и виды

15.2. Модели оценки опционов на финансовом рынке

15.3. Оценка реальных опционов

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Раздел V. Практические иллюстрации

Глава 16. Практические подходы к управлению рисками проекта

16.1. Понятие об управлении рисками проекта

16.2. Снижение рисков за счет структуризации проекта

16.3. Снижение влияния рисков событий управлением рисками

Библиографический список

Вопросы и упражнения

Глава 17. Проведение первых этапов риск-менеджмента инвестиционного проекта

17.1. Формирование информационной базы риск-анализа
инвестиционного проекта

17.2. Идентификация и качественный анализ рисков

17.3. Ранжирование рисков

17.4. Количественный анализ

Приложения

Приложение 1 (к гл. 6)

Приложение 2 (к гл. 13)