

Оглавление

Предисловие

Глава 1. РИСК КАК ЭКОНОМИЧЕСКАЯ КАТЕГОРИЯ, ЕГО СУЩНОСТЬ

1.1. Понятия неопределенности и риска

1.2. Классификация рисков

1.3. Факторы риска

1.4. Управление рисками

Вопросы и задания для самопроверки

Глава 2. ИЗМЕРИТЕЛИ И ПОКАЗАТЕЛИ ПРОИЗВОДСТВЕННЫХ
РИСКОВ

2.1. Зоны предпринимательского риска

2.2. Математические модели и методы оценки риска

2.3. Система показателей оценки риска

1.1. Показатели оценки риска в условиях определенности .

2.4.1. Абсолютные показатели оценки риска

Оценка риска структуры активов по степени их ликвидности

Оценка риска потери платежеспособности

Оценка риска потери финансовой устойчивости

2.4.2. Относительные показатели оценки риска

Оценка риска потери платежеспособности

Оценка риска потери финансовой устойчивости и независимости

2.4.3. Общие выводы по группе абсолютных и относительных
показателей оценки риска

2.5. Показатели оценки риска в условиях частичной неопределенности

2.5.1. Вероятностные показатели риска

Точечная оценка риска

Интервальная оценка риска

2.5.2. Статистические показатели риска

Вопросы и задания для самопроверки

Задачи для самостоятельного решения

Глава 3. КОЛИЧЕСТВЕННЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ И СХЕМЫ ОЦЕНКИ РИСКОВ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ

3.1. Матрица последствий и матрица рисков

3.2. Выбор решений в условиях неопределенности

3.3. Критерий выбора решений в условиях частичной неопределенности

3.4. Критерии выбора решений в условиях полной неопределенности

3.5. Анализ доходности и риска финансовых операций на основе принципа оптимальности Парето

3.6. Экспертные методы оценки риска

3.6.1. Метод «Дельфи»

3.6.2. Метод статистической обработки результатов экспертизы

3.6.3. Оценка согласованности мнений экспертов

Вопросы и задания для самопроверки

Задачи для самостоятельного решения

Глава 4. ОСНОВЫ ФОРМИРОВАНИЯ ОПТИМАЛЬНЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПОРТФЕЛЕЙ

4.1. Основные характеристики портфеля ценных бумаг

4.2. Понятие множества эффективных портфелей

4.3. Постановка задачи об оптимальном портфеле

Вопросы и задания для самопроверки

Задачи для самостоятельного решения

Глава 5. МОДЕЛИ ОЦЕНКИ ДОХОДНОСТИ ФИНАНСОВЫХ АКТИВОВ

5.1. Основные индикаторы фондовых рынков

5.2. Уравнение линии рынка капитала (CML)

5.3. Рыночная модель оценки капитальных активов Шарпа

5.4. Определение доли рыночного и нерыночного риска активов

5.5. Модель доходности финансовых активов (CAPM)

5.6. Теория арбитражного ценообразования

Вопросы и задания для самопроверки

Использованная и рекомендуемая литература

Основная

Дополнительная

Журналы

Интернет-ресурсы

Приложения

Приложение 1

Бухгалтерский баланс

Отчет о прибылях и убытках

Приложение 2

Критические значения выборочного коэффициента корреляции рангов

Приложение 3

Рекомендуемые темы рефератов