

Шапкин А. С.

Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: Учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 5-е изд. — М.:

Издатель- торговая корпорация «Дашков и К⁰», 2012. — 880 с.

Содержание

Предисловие

Глава 1. МЕСТО И РОЛЬ ЭКОНОМИЧЕСКИХ РИСКОВ В УПРАВЛЕНИИ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬЮ ОРГАНИЗАЦИЙ

1.1. Организации, типы предприятий, их характеристики и цели

1.2. Место и роль рисков в экономической деятельности

1.2.1. Определение и сущность рисков

1.2.2. Управление рисками

1.2.3. Классификация рисков

1.2.4. Система неопределенностей

1.3. Система управления рисками

1.3.1. Управленческая деятельность

1.3.2. Риск-менеджмент

1.3.3. Процесс управления риском

1.3.4. Математические методы оценки экономи-
ческих рисков

Глава 2. РИСКИ ПРЕДПРИЯТИЙ СФЕРЫ СЕРВИСА

2.1. Сервисные технологии

2.2. Классификация рисков предприятий сферы сервиса

2.3. Динамический анализ ситуации на рынке услуг

2.4. Модель управления рисками организаций сферы сервиса

Глава 3. ВЛИЯНИЕ ОСНОВНЫХ ФАКТОРОВ РЫНОЧНОГО РАВНОВЕСИЯ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

3.1. Факторы ограничения риска

3.2. Влияние факторов рыночного равновесия на изменение риска

- 3.2.1. Взаимосвязь рыночного равновесия и коммерческого риска
- 3.2.2. Влияние факторов рыночного равновесия на изменение коммерческого риска
- 3.2.3. Моделирование процесса достижения равновесия
- 3.2.4. Влияние изменения спроса на уровень коммерческого риска
- 3.2.5. Влияние изменения предложения на степень коммерческого риска
- 3.2.6. Построение зависимостей спроса от предложения

3.3. Влияние фактора времени на степень риска

3.4. Влияние факторов эластичности предложения и спроса на уровень риска

3.5. Влияние фактора налогообложения в рыночном равновесии на уровень риска

4. ФИНАНСОВЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

4.1. Финансовые риски

- 4.1.1. Классификация финансовых рисков
- 4.1.2. Связь финансового и операционного рычага с совокупным риском
- 4.1.3. Риски развития

4.2. Процентные риски

- 4.2.1. Виды процентных рисков
- 4.2.2. Операции с процентами
- 4.2.3. Средние величины процентов
- 4.2.4. Переменная процентная ставка
- 4.2.5. Риски процентных ставок
- 4.2.6. Процентный риск облигаций

4.3. Риск потерь от изменения потока платежей

- 4.3.1. Эквивалентные потоки
- 4.3.2. Потоки платежей

4.4. Рисковые инвестиционные процессы

- 4.4.1. Инвестиционные риски
- 4.4.2. Ставки доходности рискованных активов
- 4.4.3. Чистая дисконтированная стоимость
- 4.4.4. Аннуитет и фонд погашения
- 4.4.5. Оценка инвестиций
- 4.4.6. Рисковые инвестиционные платежи
- 4.4.7. Дисконтирование во времени

4.5. Кредитные риски

- 4.5.1. Факторы, способствующие возникновению кредитных рисков

- 4.5.2. Анализ кредитных рисков
- 4.5.3. Приемы уменьшения кредитных рисков
- 4.5.4. Платежи по кредитам
- 4.5.5. Нарращение и выплата процентов в потребительском кредите
- 4.5.6. Кредитные гарантии

4.6. Риск ликвидности

4.7. Инфляционный риск

- 4.7.1. Связь процентной ставки с уровнем инфляции
- 4.7.2. Инфляционная премия
- 4.7.3. Влиянии инфляции на различные процессы
- 4.7.4. Меры по снижению инфляции

4.8. Валютные риски

- 4.8.1. Конверсия валюты и наращение процентов
- 4.8.2. Валютные курсы во времени
- 4.8.3. Снижение валютных рисков

4.9. Риски активов

- 4.9.1. Биржевые риски
- 4.9.2. Влияние риска дефолта и налогообложения
- 4.9.3. Максимизация стоимости активов

4.10. Вероятностная оценка степени финансового риска

Глава 5. КОЛИЧЕСТВЕННЫЕ ОЦЕНКИ ЭКОНОМИЧЕСКОГО РИСКА В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ

5.1. Методы принятия эффективных решений в условиях неопределенности

5.2. Матричные игры

5.2.1. Понятие игры с природой

5.2.2. Предмет теории игр. Основные понятия

5.3. Критерии эффективности в условиях полной определенности

5.3.1. Критерий гарантированного результата

5.3.2. Критерий оптимизма

5.3.3. Критерий пессимизма

5.3.4. Критерий минимаксного риска Сэвиджа

5.3.5. Критерий обобщенного максимина (пессимизма — оптимизма) Гурвица

5.4. Сравнительная оценка вариантов решений в зависимости от критериев эффективности

5.5. Многокритериальные задачи выбора эффективных решений

5.5.1. Многокритериальные задачи

5.5.2. Оптимальность по Парето

5.5.3. Выбор решений при наличии многокритериальных альтернатив

5.6. Модель принятия решения в условиях частичной неопределенности

5.7. Определение оптимального объема швейного производства в условиях неопределенности

5.7.1. Верхняя и нижняя цена игры

5.7.2. Сведение матричной игры к задаче линейного программирования

5.7.3. Выбор оптимального ассортимента продукции

5.8. Риски, связанные с работой швейного предприятия

6. ПРИНЯТИЕ ОПТИМАЛЬНОГО РЕШЕНИЯ В УСЛОВИЯХ ЭКОНОМИЧЕСКОГО РИСКА

6.1. Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений

6.2. Оценка степени риска в условиях определенности

6.3. Выбор оптимального числа рабочих мест в парикмахерской с учетом риска обслуживания

6.4. Статистические методы принятия решений в условиях риска

6.5. Выбор оптимального плана методом построения деревьев событий

6.5.1. Дерево решений

6.5.2. Оптимизация стратегии выхода на рынок

6.5.3. Максимизация прибыли от акций

6.5.4. Выбор оптимального проекта реконструкции фабрики-химчистки

6.6. Сравнительная оценка вариантов решений

6.6.1. Выбор оптимального варианта решения с помощью статистических оценок

6.6.2. Нормальное распределение

6.6.3. Кривая рисков

6.6.4. Выбор оптимального решения с помощью доверительных интервалов

6.6.5. Модель прогнозирования издержек производства

6.7. Возникновение рисков при постановке миссии и целей фирмы

6.8. Деятельность предприятий сервиса в условиях риска

6.8.1. Фирма по отделке и дизайну помещений

6.8.2. Предприятие по выпечке хлебобулочных изделий и их последующей продаже

6.8.3. Салон красоты

Глава 7. УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМИ ПРОЕКТАМИ В УСЛОВИЯХ РИСКА

7.1. Инвестиционные проекты в условиях неопределенности и риска

7.1.1. Основные понятия инвестиционных проектов

7.1.2. Анализ и оценка инвестиционных проектов

7.1.3. Риски инвестиционных проектов

7.2. Оптимальный выбор объема инвестиций, обеспечивающий максимальный прирост выпуска продукции

7.3. Инвестиции в портфель ценных бумаг

7.3.1. Процесс управления инвестициями

7.3.2. Диверсифицированный портфель

7.3.3. Риски, связанные с инвестированием в портфель ценных бумаг

7.3.4. Практические рекомендации по формированию портфеля инвестиций

7.4. Анализ экономической эффективности инвестиционного проекта

7.4.1. Анализ сопутствующих факторов риска

7.4.2. Предварительная оценка и отбор предприятий

7.4.3. Оценка финансового состояния предприятия как объекта инвестирования

7.4.4. Примеры анализа с использованием финансовых коэффициентов

7.4.5. Оценка перспектив развития организации

7.4.6. Сравнительный финансовый анализ инвестиционных проектов

7.4.7. Анализ методов обследования организации на месте

7.5. Учет риска в инвестиционных проектах

7.5.1. Модель оценки риска проекта

7.5.2. Учет риска при инвестировании

7.5.3. Практические выводы по управлению рисковыми инвестиционными проектами

Глава 8. РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ ТУРИЗМА

8.1. Факторы, влияющие на динамику развития туризма

- 8.1.1. Развитие туризма в России
- 8.1.2. Виды и формы туризма
- 8.1.3. Особенности туризма — как факторы неопределенности развития

8.2. Психология воздействия туризма на участников и окружающих

- 8.2.1. Мотивация поездок
- 8.2.2. Воздействие туризма

8.3. Риски, связанные с туристской деятельностью

- 8.3.1. Факторы, воздействующие на туризм и экономику туризма
- 8.3.2. Классификация рисков туризма

8.4. Экономическое воздействие туризма

8.5. Принятие управленческого решения

8.6. Анализ деятельности организации по оказанию туристских услуг в условиях риска

Глава 9. РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ ГОСТИНИЦ И РЕСТОРАНОВ

9.1. Развитие гостиничных предприятий

9.2. Факторы развития ресторанного бизнеса

9.3. Особенности и специфика гостеприимства

9.4. Риски, присущие индустрии гостеприимства, и управление ими

- 9.4.1. Выявление рисков
- 9.4.2. Риски инвестиционных проектов

9.4.3. Снижение рисков индустрии гостеприимства

9.5. Управленческие решения в бизнесе гостеприимства

Глава 10. ОСНОВНЫЕ МЕТОДЫ И ПУТИ СНИЖЕНИЯ ЭКОНОМИЧЕСКИХ РИСКОВ

10.1. Общие принципы управления риском

10.1.1. Схема процесса управления риском

10.1.2. Примеры рисков

10.1.3. Выбор приемов управления риском

10.2. Диверсификация

10.3. Страхование риска

10.3.1. Сущность страхования

10.3.2. Основные характеристики страховых контрактов

10.3.3. Расчет страховых операций

10.3.4. Страховой контракт

10.3.5. Преимущества и недостатки страхования

10.4. Хеджирование

10.4.1. Стратегии управления риском

10.4.2. Основные понятия

10.4.3. Форвардные и фьючерсные контракты...

10.4.4. Хеджирование валютного курса

10.4.5. Основные аспекты риска

10.4.6. Хеджирование валютного курса с помощью свопа

10.4.7. Опционы

- 10.4.8. Страхование или хеджирование
- 10.4.9. Синхронизация потоков денежных средств
- 10.4.10. Модель хеджирования
- 10.4.11. Измерение эффективности хеджирования
- 10.4.12. Минимизация расходов на хеджирование
- 10.4.13. Коррелированная операция хеджирования

10.5. Лимитирование

10.6. Резервирование средств (самострахование)

10.7. Качественное управление рисками

10.8. Приобретение дополнительной информации

10.9. Оценка эффективности методов управления рисками

10.9.1. Финансирование рисков

10.9.2. Оценка эффективности управления рисками

Глава 11. ПСИХОЛОГИЯ ПОВЕДЕНИЯ И ОЦЕНКИ ЛИЦА, ПРИНИМАЮЩЕГО РЕШЕНИЕ

11.1. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений

11.1.1. Психологические проблемы поведения экономической личности

11.1.2. Управленческие действия предпринимателя в сфере услуг

11.1.3. Отношение личности к риску

11.1.4. Интуиция и риск

11.2. Теория ожидаемой полезности

11.2.1. Графики функций полезности

11.2.2. Теория ожидаемой полезности

11.2.3. Учет отношения лица, принимающего решение, к риску

11.2.4. Групповое принятие решения

11.3. Теория рационального поведения

11.3.1. Теория перспективы

11.3.2. Рациональный подход к принятию решения

11.3.3. Асимметрия принятия решений

11.3.4. Инвариантность поведения

11.3.5. Роль информации в принятии решений

11.4. Конфликтные ситуации

11.5. Роль руководителя в принятии рискованных решений

11.5.1. Принятие решения в условиях риска

11.5.2. Требования к лицу, принимающему решение

11.5.3. Принципы оценки эффективности решений, принимаемых ЛПР

Вопросы для повторения

Литература

Оглавление