

Кричевский М.Л.

Финансовые риски : учебное пособие / М.Л. Кричевский. — 2-е изд.,
стер. - М.: КНОРУС.2013. - 248 с. - {Бакалавриат}.

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение	5
Глава 1. Основные концепции риск-менеджмента	
1.1. Сущность риска	9
1.2. История становления риск-менеджмента	13
1.3. Цели и задачи риск-менеджмента	24
1.4. Регуляторы рисков	30
1.5. Классификация и виды рисков	36
Термины и определения	41
Вопросы и задания для самопроверки	41
Глава 2. Рыночный риск	
2.1. Разновидности рыночного риска	42
2.2. Основные модели расчета $\Delta \text{Value-at-Risk}$	50
2.2.1. Ковариационный метод расчета ΔVaR	54
2.2.2. Метод исторических симуляций	59
2.2.3. Геометрическое броуновское движение	61
2.2.4. Моделирование методом Монте-Карло	66
2.3. Анализ сценариев	72
2.4. Тестирование моделей	74
2.5. Методология KlMcIpc5	78
Термины и определения	85
Вопросы и задания для самопроверки	86
Глава 3. Кредитный риск	
3.1. Кредитные рейтинговые системы	87
3.2. Миграция рейтингов	92
3.3. Методология StcIcMcIpcz	95
3.4. Структурные модели	105
3.4.1. Модель Мертона	105
3.4.2. Оценивание в модели Мертона	108
3.4.3. КМУ-нотль	112
3.5. Пороговые модели	120
3.5.1. Индикаторы состояния и дефолта	121
3.5.2. Корреляция активов	123
3.6. Смешанные модели	131
3.6.1. Модели сокращенной формы	132
3.6.2. Методология CzeMII^+K	140
Термины и определения	149
Вопросы и задания для самопроверки	150

Глава 4. Операционный риск

4.1. Классификация операционных рисков	151
4.2. Методы оценивания операционного риска	153
4.3. Формирование данных по операционным потерям.	157
4.4. Основы теории экстремальных значений при оценке риска	160
4.5. Страновой риск_____167	
4.5.1. Методы оценки странового риска	168
4.5.2. Формирование страновых рейтингов.	170
Термины и определения.	187
Вопросы и задания для самопроверки.	188

Глава 5. Внутренние рейтинговые системы

5.1. Основные понятия нечеткой логики.	189
5.1.1. Нечеткие множества.	191
5.1.2. Функции принадлежности.	196
5.1.3. Лингвистические переменные.	198
5.1.4. Нечеткий логический вывод	200
5.1.5. Нечеткая база правил.	201
5.2. Алгоритмы нечеткого вывода.	202
5.3. Построение внутренней рейтинговой системы на основе нечеткой логики.	205
5.4. Основные сведения об искусственных нейронных сетях.	217
5.4.1. Становление нейронной доктрины.	217
5.4.2. Парадигмы обучения_____221	
5.4.3. Нейросетевые топологии.	225
5.4.4. Алгоритмы обучения.	227
5.5. Метод обратного распространения ошибки.	228
5.6. Создание внутренней рейтинговой системы на основе нейронных сетей.	235
Термины и определения.	242
Вопросы и задания для самопроверки.	243

Заключение.	244
----------------------------	------------