

Баюк О.А.

Принятие финансовых решений в условиях сравнительной неопределенности : монография / О.А. Баюк, А.В. Браилов, И.Е. Де-нежкина, С.А. Зададаев. — М. : Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2018. — 106 с. — (Научная книга).

СОДЕРЖАНИЕ

Введение.....	5
1. Разработка алгоритма формирования отношения предпочтения по совокупности несравнимых макроэкономических параметров.....	8
1.1. Отношение предпочтения и выбор по Парето.....	8
1.2. Разработка процедуры формирования обобщенного рейтинга по совокупности критериев (ранжирование по Парето).....	10
1.3. Теоретическое обоснование существования введенного рейтинга.....	И
2. Реализация алгоритма ранжирования и анализ полученных рейтингов... ..	16
2.1. Сравнение регионов РФ на основании ранжирования.....	16
2.2. Использование ранжирования для принятия решения в рамках мониторинга несравнимых объектов.....	21
2.3. Сравнение рейтингов при принятии решений в условиях неопределенности.....	31
3. Задача первичного выбора в портфельном анализе.....	40
3.1. Задача формирования вектора уровней.....	40
3.2. Вычислительная проблема в задаче первичного отбора в портфельном анализе.....	42
3.3. Торговые стратегии в задаче первичного отбора в портфельном анализе.....	44
3.4. Практические рекомендации по стратегии отбора акций.....	49
3.5. Предварительные выводы.....	49
4. Задача сравнительного стоимостного анализа недвижимости.....	50
4.1. Постановка задачи.....	50
4.2. Сравнительный подход к оценке недвижимости.....	50
4.3. Модель стоимости квартиры.....	52
4.4. Алгоритм уточнения интервальной оценки стоимости объекта на основе разработанной стратегии.....	55
4.5. Пример оценки стоимости квартиры.....	56
4.6. Предварительные выводы.....	62
5. Оценка устойчивости банковской системы с использованием процедуры ранжирования по Парето.....	63
5.1. Введение.....	63
5.2. Методика оценки устойчивости банковской системы.....	65
5.3. Постановка задачи ранжирования банков.....	69
5.4. Алгоритм анализа устойчивости банков.....	70
5.5. Определение новой классификации банков по устойчивости.....	71
5.6. Введение вероятностной меры надежности банка.....	72
5.7. Анализ деятельности банка «Траст».....	75
5.8. Предварительные выводы.....	78
ЗАКЛЮЧЕНИЕ.....	80
СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ.....	84
ПРИЛОЖЕНИЯ.....	86
Приложение А Программная реализация алгоритма ранжирования.....	86

Приложение Б Таблица П2. Группы параметров, используемых в экспресс-анализе.....	90
Приложение В Результаты расчетов доходности портфелей по 16 уровням ...	94
Приложении Д МК-программа для формирования портфеля акций	99
Приложение Е Текст подпрограммы ранжирования по Парето в задаче оценки недвижимости.....	101
Приложение Ж Исходные данные для задачи оценки квартиры.....	103