

Гурнович, Татьяна Генриховна.

Оценка и анализ рисков : учебник / Т.Г. Гурнович, Е.А. Остапенко, С.А. Молчаненко ; под общ. ред. Т.Г. Гурнович. — Москва : КНОРУС, 2019. — 252 с. — (Бакалавриат).

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение.....	5
---------------	---

РАЗДЕЛ I ТЕОРИЯ РИСКА

ГЛАВА 1. РИСКИ: ПОНЯТИЕ И КЛАССИФИКАЦИЯ.....	7
1.1. Категории «риск» и «неопределенность»: понятие и сущность.	7
1.2. Экономическая природа рисков.....	12
1.3. Система рисков и их классификация.....	15
Учебно-методические материалы.....	36
ГЛАВА 2. ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ИССЛЕДОВАНИЯ РИСКОВ: КЛАССИЧЕСКИЕ И СОВРЕМЕННЫЕ АСПЕКТЫ.....	51
2.1. Характеристика основных концепций риска.....	51
2.2. Анализ и синтез теоретических взглядов на риск.....	59
Учебно-методические материалы.....	64

РАЗДЕЛ II. ИДЕНТИФИКАЦИЯ И ОЦЕНКА РИСКОВ

ГЛАВА 3. СИСТЕМА ВЫЯВЛЕНИЯ РИСКОВ.....	68
3.1. Информационное обеспечение системы выявления рисков.	68
3.2. Основные подходы к выявлению риска.....	72
Учебно-методические материалы.....	85
ГЛАВА 4. СХЕМЫ ОЦЕНКИ РИСКОВ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ.	94
4.1. Матрицы последствий и рисков.....	94
4.2. Анализ решений в условиях неопределенности.....	100
4.3. Решение оптимизационных задач.....	108
Учебно-методические материалы.....	110
ГЛАВА 5. ИНСТРУМЕНТЫ КОЛИЧЕСТВЕННОЙ ОЦЕНКИ РИСКОВ.....	120
5.1. Общие подходы к количественной оценке риска.....	120
5.2. Доходность и волатильность.....	127
5.3. Коэффициенты бета и альфа.....	129
5.4. Показатель <i>va/i/e at risk (VaR)</i>	131
Учебно-методические материалы.....	148

РАЗДЕЛ III. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

ГЛАВА 6. СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ.....	163
6.1. Общие принципы управления рисками.....	163
6.2. Цели и задачи системы управления рисками.....	171
6.3. Этапы управления риском.....	174
Учебно-методические материалы.....	186
ГЛАВА 7. МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ.....	198
7.1. Уклонение от риска.....	198
7.2. Диверсификация.....	201
7.3. Страхование рисков.....	203
7.4. Лимитирование.....	219
Учебно-методические материалы.....	221
Глоссарий.....	234
Рекомендуемая литература.....	249