

Струченкова, Татьяна Владимировна.

Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие /Т.В. Струченкова. - Москва : КНОРУС, 2019. - 210 с.

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение.....	5
Глава 1. РИСК И ЕГО СУЩНОСТЬ	
1.1. Определение понятия «риск».....	7
1.2. Риск и неопределенность.....	10
1.3. Классификация рисков.....	12
Глава 2. ВАЛЮТНЫЙ РИСК	
2.1. Валютный риск и причины его возникновения.....	19
2.2. Виды валютных рисков.....	27
2.3. Валютный риск и валютная позиция.....	35
2.4. Управление валютным риском.....	41
Глава 3. ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ВАЛЮТНОГО КУРСА	
3.1. Теоретические основы прогнозирования валютного курса.....	50
3.2. Эволюция подходов к прогнозированию валютного курса.....	60
3.3. Стохастический анализ.....	64
3.4. «Хаотический» анализ.....	71
3.5. Фундаментальный анализ.....	73
3.6. Экспертный анализ.....	85
3.7. Нейросетевой анализ.....	86
3.8. Технический анализ.....	90
Глава 4. ОЦЕНКА ВАЛЮТНОГО РИСКА	
4.1. Статистические методы оценки риска.....	117
4.2. Методы экспертных оценок.....	122
Глава 5. МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ ВАЛЮТНЫМ РИСКОМ	
5.1. Обзор методов управления рисками.....	126
5.2. «Внутренние» методы управления валютными рисками.....	127
5.2.1. Защитные оговорки.....	127
5.2.2. Управление сроками платежей и поступлений.....	129
5.2.3. Выбор валюты платежных документов.....	130
5.2.4. Метод компенсаций.....	130
5.2.5. Управление активами и пассивами.....	131

5.3. Использование инструментов срочного рынка для управления валютным риском.....	134
5.3.1. Валютные форварды.....	137
5.3.2. Валютные фьючерсы.....	142
5.3.3. Валютные свопы.....	150
5.3.4. Валютные опционы.....	157
Заключение.....	177
Рекомендуемая литература.....	178
Приложения	
Приложение 1.....	179
Приложение 2.....	180
Приложение 3.....	181
Приложение 4.....	183
Приложение 5.....	185
Приложение 6.....	195
Приложение 7.....	198
Приложение 8.....	199
Приложение 9.....	201
Приложение 10.....	202
Приложение 11.....	205
Приложение 12.....	207
Приложение 13.....	210