



Научная библиотека Государственного образовательного учреждения
высшего профессионального образования
Луганской Народной Республики
«Донбасский государственный технический университет»

РИСКИ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Виртуальная выставка

***Составитель – зав. сектором
отдела обслуживания А. И. Кебус***



RISK

- возможная опасность какого-либо неблагоприятного исхода.

*Больше всех рискует тот,
кто никогда не рискует.
И. А. Бунин*

ВОЗМОЖНОСТИ

РИСКИ



Мир, в котором мы живём, кажется то прекрасным, то ужасным. Если задуматься всерьёз, то мы мало о нём знаем. Но мы всё-таки знаем, что «под Богом ходим», что от «сумы и от тюрьмы не зарекайся», что «человек предполагает, а Бог располагает» и т. д. О чём всё это? О **РИСКАХ**.

История возникновения понятия «**РИСК**» имеет далёкие корни. С **РИСКОМ** была связана жизнь человека ещё в глубокой древности. В те времена **РИСК** позволял человеку выжить. По мере развития цивилизации появляются товарно-денежные отношения и **РИСК** становится экономической категорией.

Основная особенность современного **РИСКА** заключается в его тотальном и всеобъемлющем характере. **РИСКИ** есть практически во всех сферах деятельности человека.

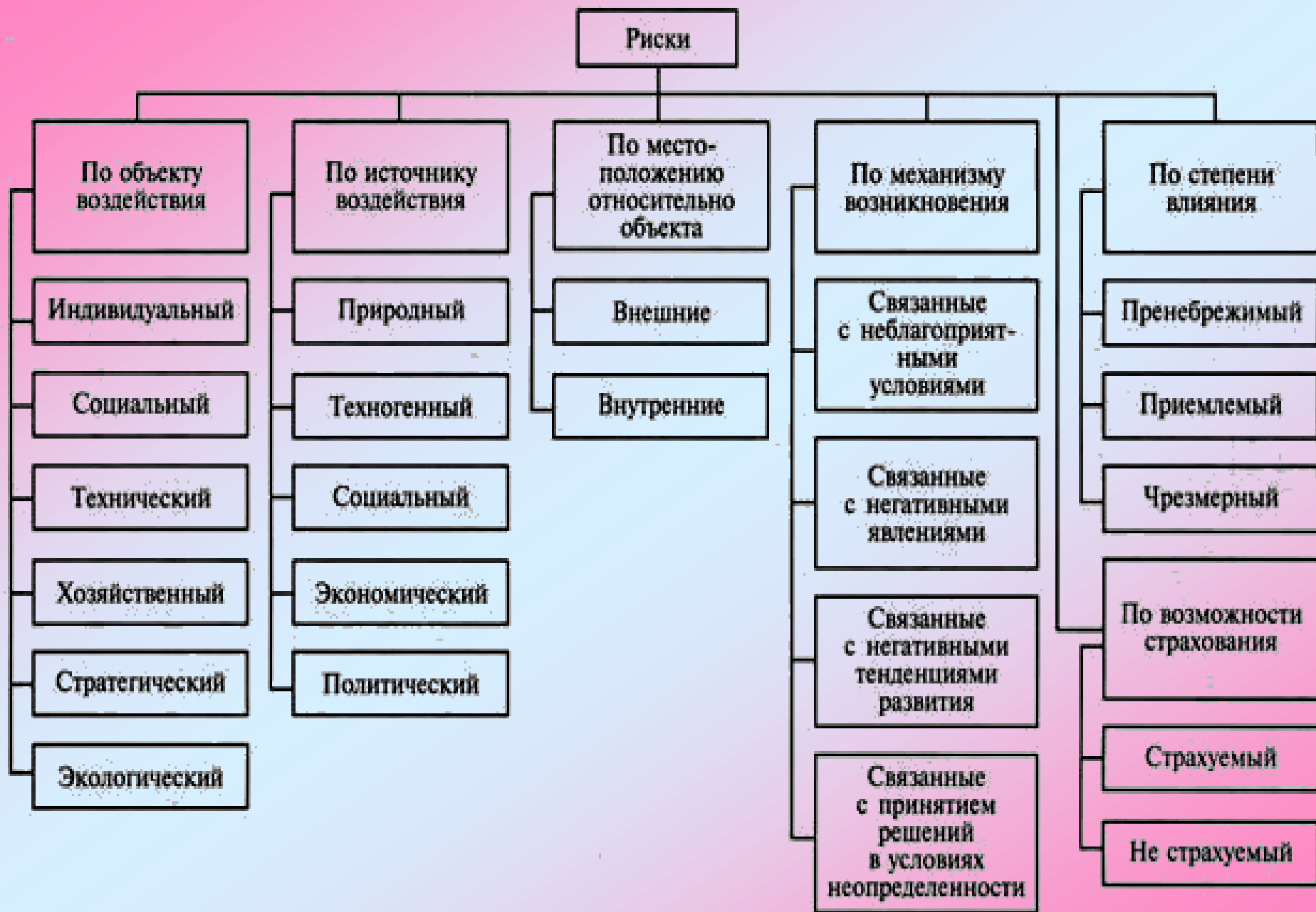
Цель данной выставки – привлечь внимание читателя, вызвать у него желание посетить библиотеку и ознакомиться с наиболее интересными и значимыми книгами по теме

«РИСКИ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ».

Разделы выставки:

- 1. Риск как экономическая категория**
- 2. Моделирование рисков ситуаций**
- 3. Управление рисками (риск-менеджмент)**

Классификация рисков



1. Риск как экономическая категория

- **Экономические (коммерческие) риски** - это риски, обусловленные неблагоприятными изменениями в экономике предприятия или в экономике страны. Наиболее распространенным видом экономического риска, в котором сконцентрированы частные риски, являются изменения конъюнктуры рынка, несбалансированная ликвидность (невозможность своевременно выполнять платежные обязательства), изменения уровня управления и др.



У01

В55 Вишняков Я. Д.

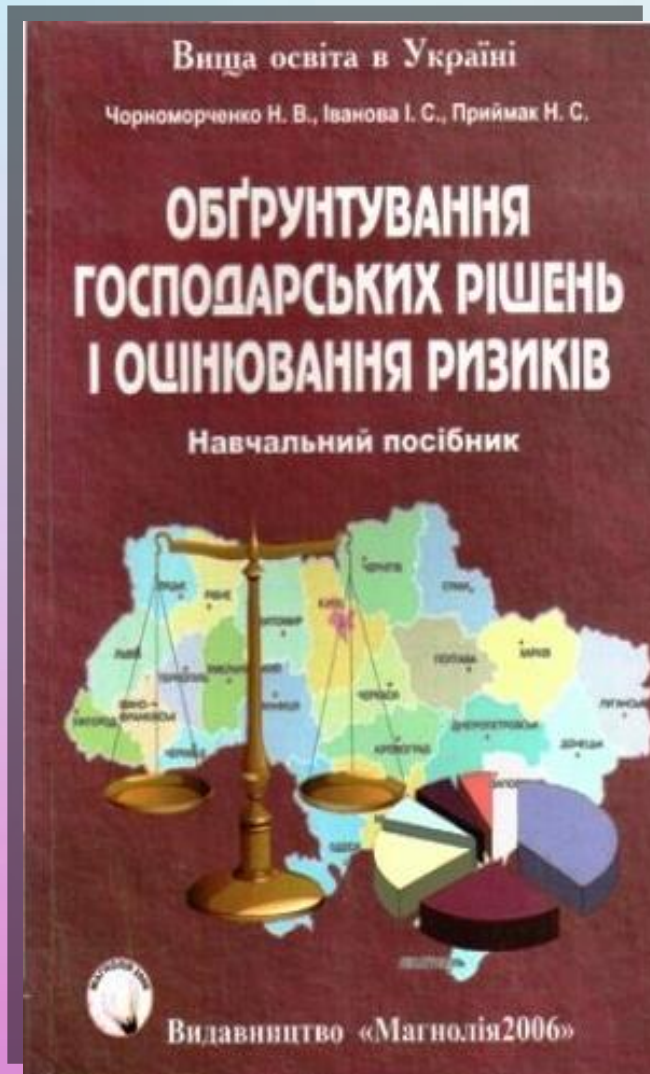
Общая теория рисков : учеб. пособие для студ. вузов, обуч. по спец. "Менеджмент организации" / Я. Д. Вишняков, Н. Н. Радаев. – М. : Academia, 2007. – 364 с. : ил. – (Высшее профессиональное образование. Экономика и управление).



Рассмотрены различные виды рисков и приведена их классификация. Дана характеристика рискообразующих факторов — природных, техногенных, социальных, социально-политических. Систематически изложены общие вопросы анализа (идентификация, оценка, прогноз, приемлемость) рисков, а также управления (принятие решений и обоснование мер) рисками для различных объектов.

Для студентов высших учебных заведений. Может быть полезно специалистам, занимающимся вопросами обеспечения безопасности и риск-менеджментом, научным сотрудникам, аспирантам.

Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків : навч.-метод. посібник для самостійного вивчення дисципліни / Н. В. Чорноморченко, І. С. Іванова, Н. С. Приймак. – Львів : Магнолія 2006, 2010. – 257 с. : іл. + додатки. – (Вища освіта в Україні).



Навчальний посібник для самостійного вивчення дисципліни, складений у відповідності до програми курсу.

У навчальному посібнику висвітлюються найсуттєвіші аспекти обґрунтування господарських рішень, зокрема, розглянуто економічну сутність та види господарських рішень; принципи та методи аналізу господарських рішень; інструментарій економічного обґрунтування ефективності рішень; процедуру моделювання процесу прийняття рішень; можливості використання економіко-математичних методів та ЕОМ для прийняття господарських рішень в діяльності підприємств; особливості розробки господарських рішень в різних умовах господарювання.

До складу посібника включено стислий виклад тематичного матеріалу, контрольні запитання й практичні задачі, питання для дискусійного обговорення, проблемні питання, тестові завдання одиничного та альтернативного вибору відповідей, перелік тем реферативних доповідей, завдання для виконання індивідуальних робіт з використанням ЕОМ та методик проведення ділової гри.

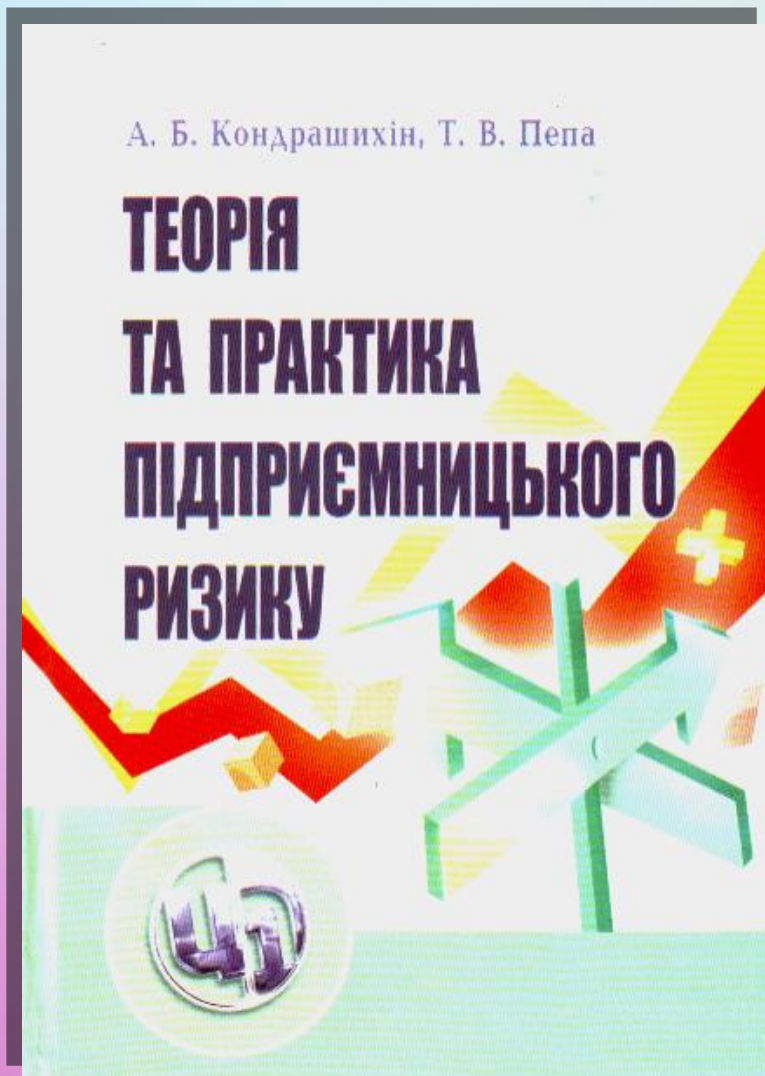
Вивчення та осмислення запропонованого матеріалу дозволить якісно та професійно приймати та реалізувати різноманітні господарські рішення.

Посібник розрахований для підготовки студентів денної та заочної форм навчання економічного напрямку, а також для слухачів системи підвищення кваліфікації і перепідготовки кадрів.

У01

К64 Кондрашихін А. Б.

Теорія та практика підприємницького ризику : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / А. Б. Кондрашихін, Т. В. Пепа. – К. : Центр учбової літератури, 2009. – 224 с. : іл.



Розглянуто теоретико-методологічні основи дослідження, обліку та оцінки ризиків підприємницької діяльності в господарському комплексі України. Визначено джерела ризиків і причини виникнення, методи зниження їх негативного впливу на господарські результати суб'єктів та економіку в цілому.

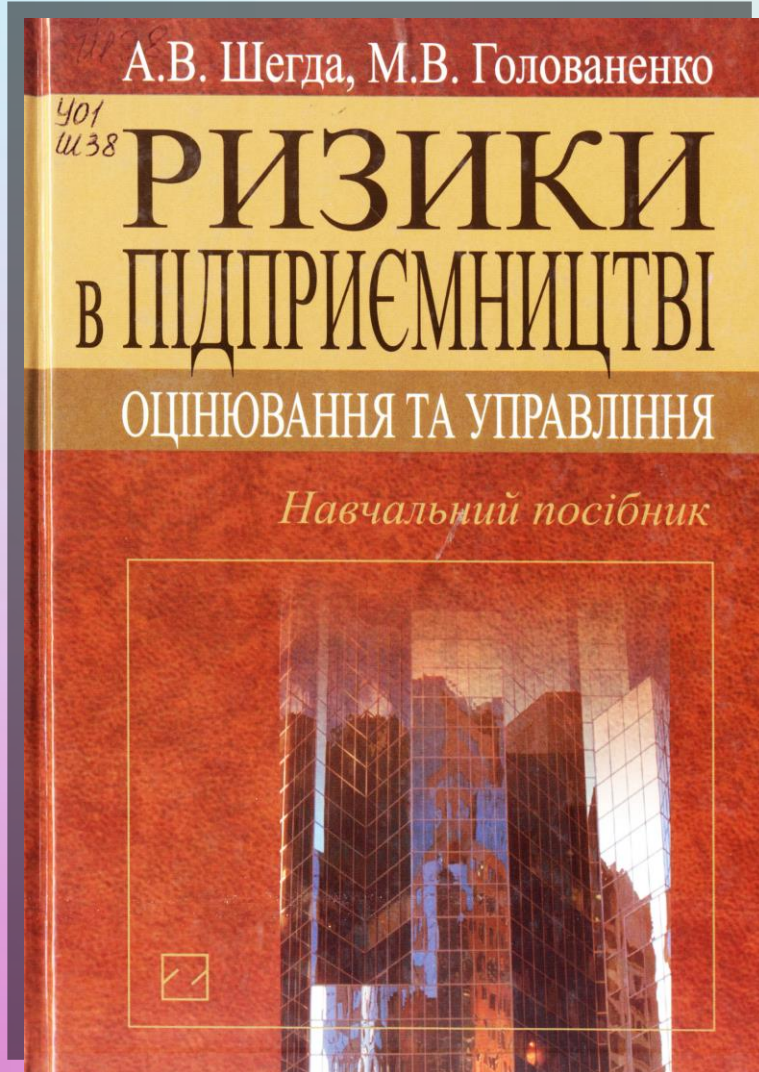
Матеріал ґрунтується на сучасних прийомах економічного дослідження – системно-структурному аналізі, регіонально-комплексному підході. Виділені нові види ризиків, які властиві етапу економічних трансформацій національного господарства.

Навчальний посібник адресований студентам спеціальностей «Банківська справа», «Фінанси», «Облік і аудит», аспірантам і здобувачам наукового ступеня, викладачам вищих учбових закладів, фахівцям-практикам сучасних господарських комплексів, працівникам державних органів.

У01

Ш38 Шегда А. В.

Ризики в підприємстві : оцінювання та управління : навч. посібник / А. В. Шегда, М. В. Голованенко ; за ред. А. В. Шегди. – К. : Знання, 2008. – 271 с. : іл. + додатки.

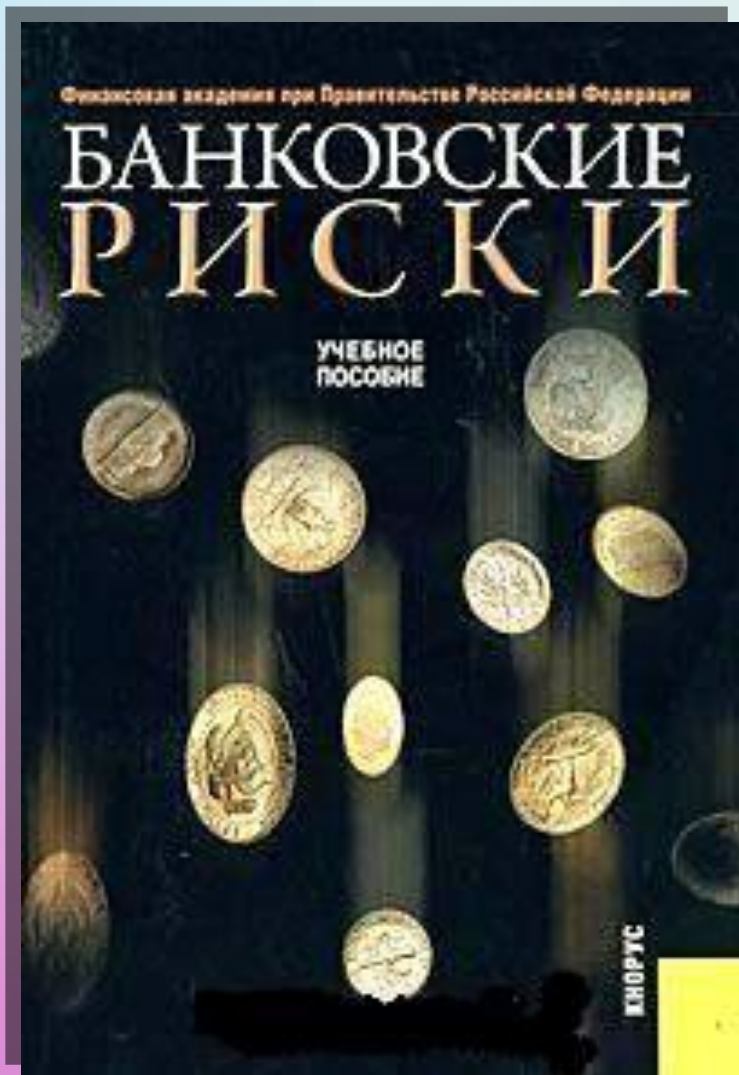


Розглядаються проблеми оцінювання та управління ризиками підприємницької діяльності, зокрема передумови та фактори, які зумовлюють їх виникнення, їх основні різновиди та особливості. Значна увага приділяється процедурі розробки ефективних управлінських рішень в умовах ризику. Розкриваються теоретичні основи мінімізації ризиків в умовах конфлікту та невизначеності з використанням апарату теорії ігор, елементи портфельної теорії. Наводяться приклади застосування Microsoft Excel для розв'язання задач вибору оптимальних стратегій та формування оптимального портфеля.

Розраховано на студентів та викладачів вищих навчальних закладів, аспірантів, науковців, усіх, хто цікавиться проблемами прийняття ефектних управлінських рішень та оптимізації ризику.

У526

Б23 Банковские риски : учеб. пособ. для студ., обуч. по спец. «Финансы и кредит» / Л. Н. Красавина, О. И. Лаврушин, Н. И. Валенцева и др. ; под ред. О. И. Лаврушина, Н. И. Валенцевой. – 2-е изд., стер. – М. : КНОРУС, 2008. – 232 с. : ил.



Учебное пособие составлено в соответствии с требованиями Государственного образовательного стандарта Учебно-методического объединения в области финансов, учета и мировой экономики. В основу пособия положена научно-исследовательская работа в рамках Центра фундаментальных и прикладных исследований Финансовой академии при Правительстве РФ. Исследование выполнялось коллективом преподавателей кафедры "Денежно-кредитные отношения и банки".

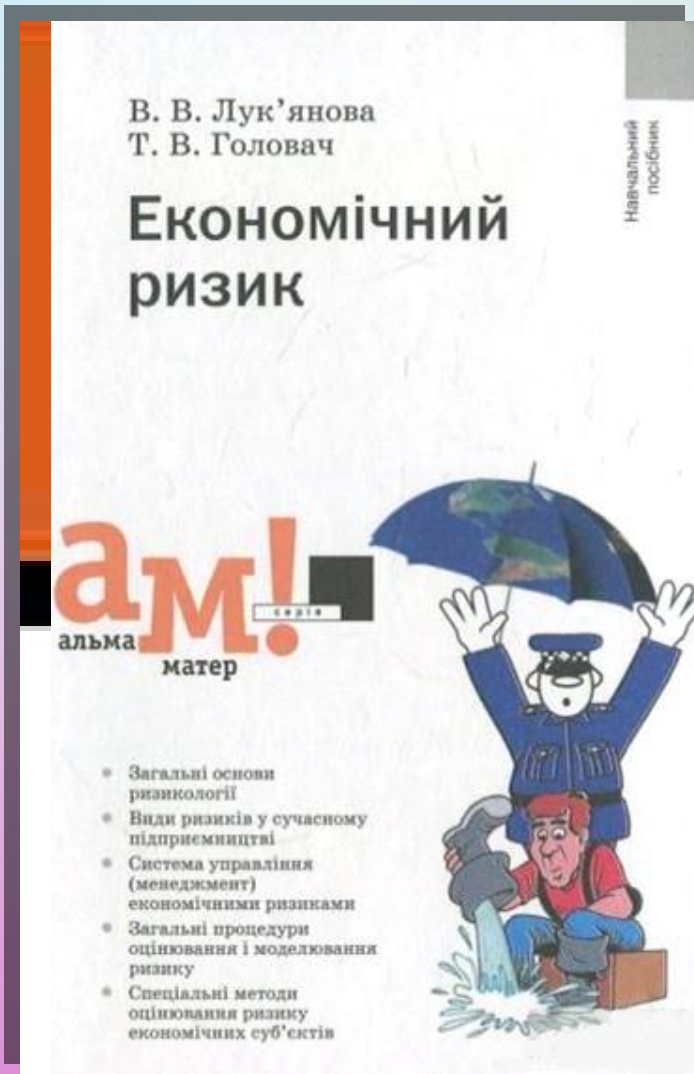
Содержание учебного пособия представляет собой сочетание теории банковских рисков и практики управления ими с учетом действующей нормативно-правовой базы. Особое внимание уделено сущности и классификации рисков, системе управления ими, основным видам частных и комплексных рисков, а также проблемам современного банковского риск-менеджмента.

Для студентов вузов и слушателей ИППК, обучающихся по специальности "Финансы и кредит", в качестве дополнительной литературы к основным учебникам по курсам, связанным с теорией и практикой банковского дела.

У01

Л84 Лук'янова В. В.

Економічний ризик : навч. посібник [для студ. екон. спец. вищих навч. закладів] / В. В. Лук'янова, Т. В. Головач. – К. : Академвидав, 2007. – 464 с. : іл. – (Альма-матер).



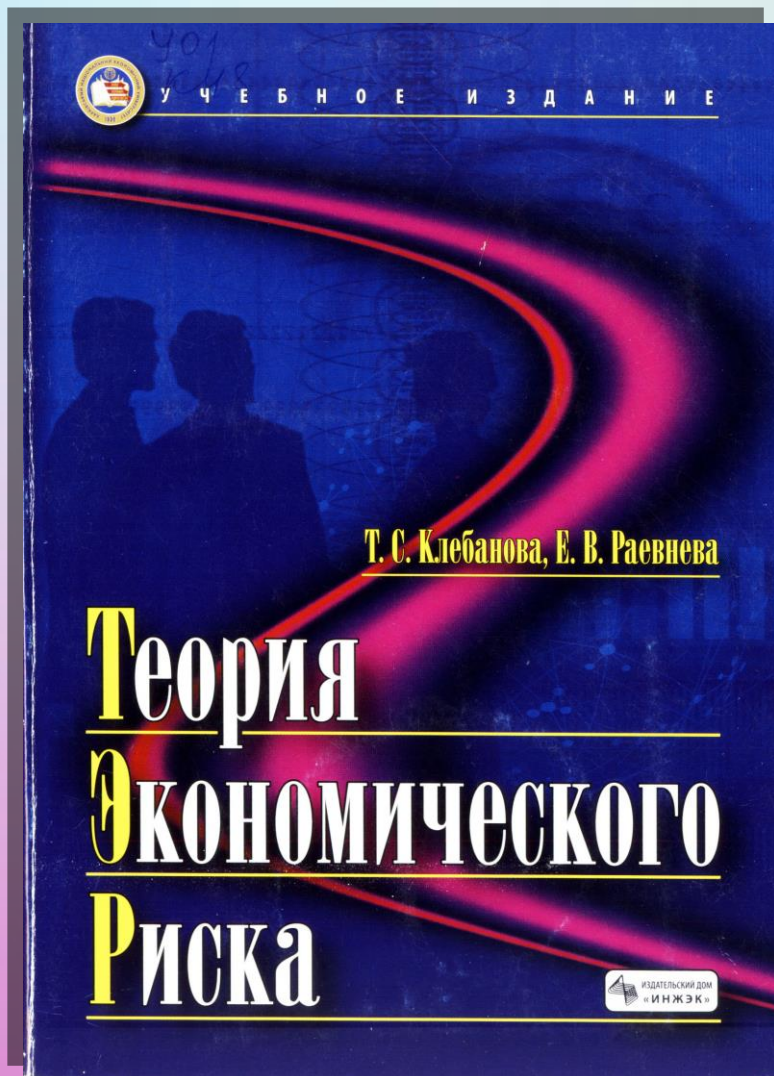
У посібнику системно розглянуто сутність ризикології як науки, особливості і різні види економічних ризиків, проаналізовано їх вплив на розвиток підприємств, фірм, компаній та економіки загалом, узагальнено світовий і вітчизняний досвід оцінювання і оптимізації ризиків. Засвоєнню теоретичного матеріалу сприятимуть вміщені у посібнику тести, індивідуальні завдання, розрахункові роботи.

Для студентів вищих навчальних закладів, які опановують економічні спеціальності.

У01

К48 Клебанова Т. С.

Теория экономического риска : Theory of economic risc : учеб.
пособие для вузов / Т. С. Клебанова, Е. В. Раевнева. – [2-е изд.],
[перераб. и доп.]. – Харьков : ИНЖЭК, 2007. – 208 с. : ил.



Рассматриваются теоретические, методологические и практические аспекты категории экономического риска. Представлены классификация и характеристика рисков, возникающих в различных сферах предпринимательской деятельности, рассмотрены общие и специальные методы измерения риска, а также пути и способы его предупреждения и снижения.

Издание предназначено для студентов высших учебных заведений, слушателей бизнес-школ, руководителей и менеджеров предприятий и организаций.

Учебное пособие также представляет интерес для преподавателей и аспирантов.

У01

Ш23 Шапкин А. С.

Экономические и финансовые риски : оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин. – 4-е изд. – М. : ИТК"Дашков и К", 2006. – 544 с. : ил.



В книге излагается сущность экономического риска, рассматриваются факторы, влияющие на уровень риска, даются методы количественной оценки экономического риска, приводятся практические примеры принятия эффективных решений в условиях риска для конкретных экономических ситуаций.

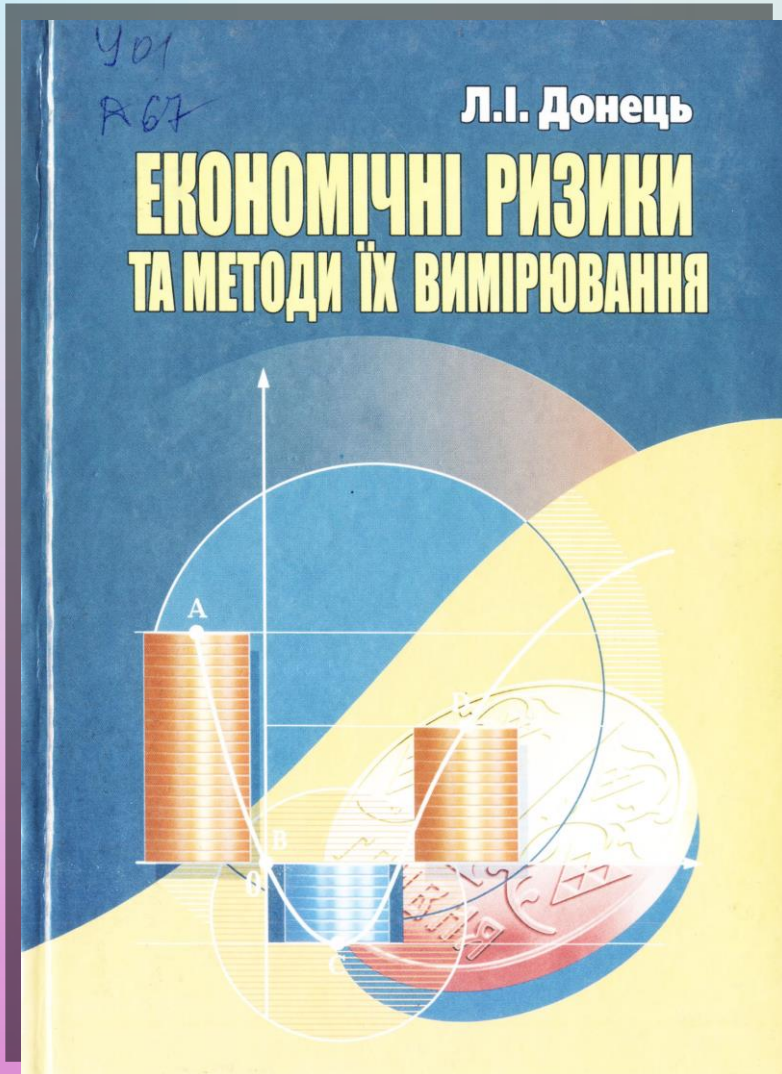
Рассматривается классификация финансовых рисков, излагаются основные методы финансовой математики рискованных процессов, раскрываются новые подходы к снижению степени экономического риска, а также вопросы формирования оптимального портфеля ценных бумаг. Объясняются современная портфельная теория и теория рынка капитала, дается обзор основных методов управления портфелем инвестиций, анализируются и сравниваются различные портфельные теории. Значительное внимание уделяется психологии поведения и оценке лица, принимающего решение.

Для специалистов, изучающих и использующих экономико-математические методы в управлении экономическими рисками, специалистов банковских и финансовых структур, работников пенсионных, страховых и инвестиционных фондов, практиков фондового рынка, а также студентов экономических вузов.

У01

Д67 Донець Л. І.

Економічні ризики та методи їх вимірювання : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / Л. І. Донець. – К. : Центр навчальної літератури, 2006. – 312 с. : іл.



У навчальному посібнику розглядаються питання ідентифікації, оцінки та мінімізації економічних ризиків. Велика увага приділяється висвітленню засобів управління ризиками та їх урахуванню під час прийняття управлінських рішень в умовах невизначеності і ризику. Теоретичний матеріал структурований згідно з логікою засвоєння студентами основних понять, економічних категорій, методів і способів їх використання в практичній діяльності.

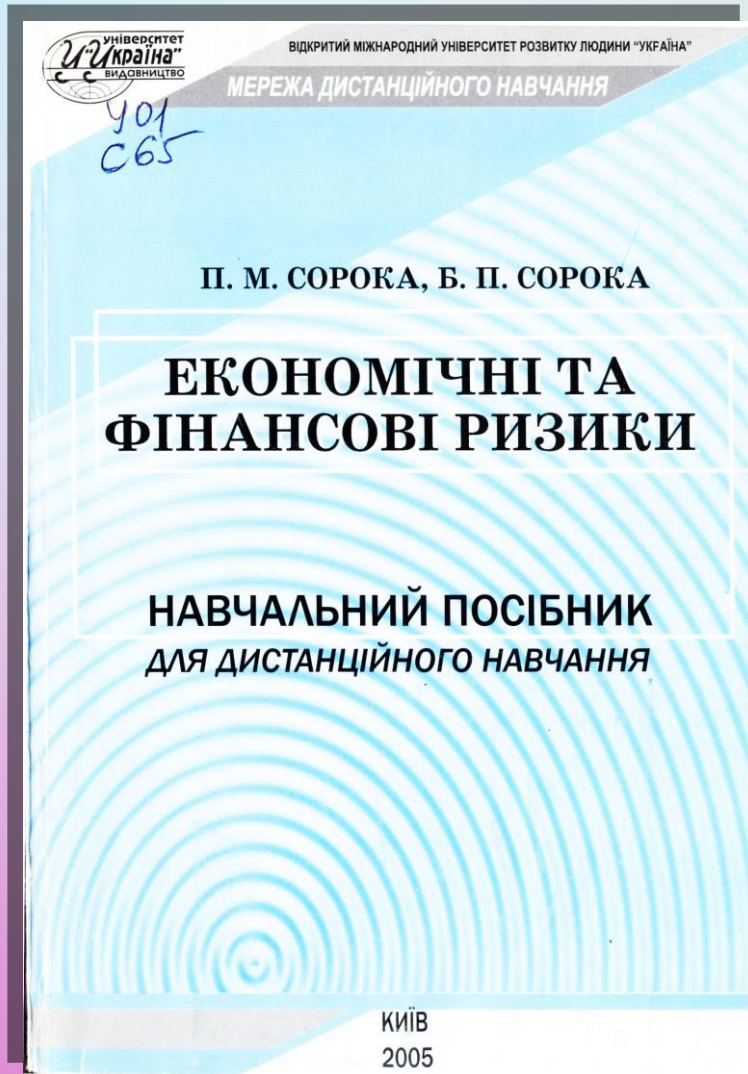
До кожного розділу подано питання для поглибленого засвоєння знань студентами, тестові завдання для самоконтролю, завдання для самостійної роботи.

Посібник призначено для студентів економічних спеціальностей вищих навчальних закладів усіх форм навчання.

У01

С65 Сорока П. М.

Економічні та фінансові ризики : навч. посібник для дистанційного навчання / П. М. Сорока, Б. П. Сорока ; [за ред. О. Д. Гудзинського]. – К. : Університет "Україна", 2006. – 266 с. : іл.



У навчальному посібнику наведено основні відомості про економічні ризики, подано класифікацію та характеристику ризиків. Розглянуто загальні та спеціальні методи оцінки ризику. Значну увагу приділено прийняттю рішень в умовах ризику. В останньому розділі посібника описано шляхи та способи зниження ризику.

Посібник призначено для студентів економічних спеціальностей вищих навчальних закладів, передусім тих, хто навчається за напрямками «Економіка і підприємництво» і «Менеджмент». Також цей посібник буде корисним для викладачів, економістів, менеджерів, працівників інвестиційних фондів, банків, страхових компаній і всіх тих, хто цікавиться проблемами ризику.

У5

К49 Клименко С. М.

Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків : навч. посібник для студ. екон. спец. вузів / С. М. Клименко, О. С. Дуброва. – К. : КНЕУ, 2005. – 250 с. : іл.



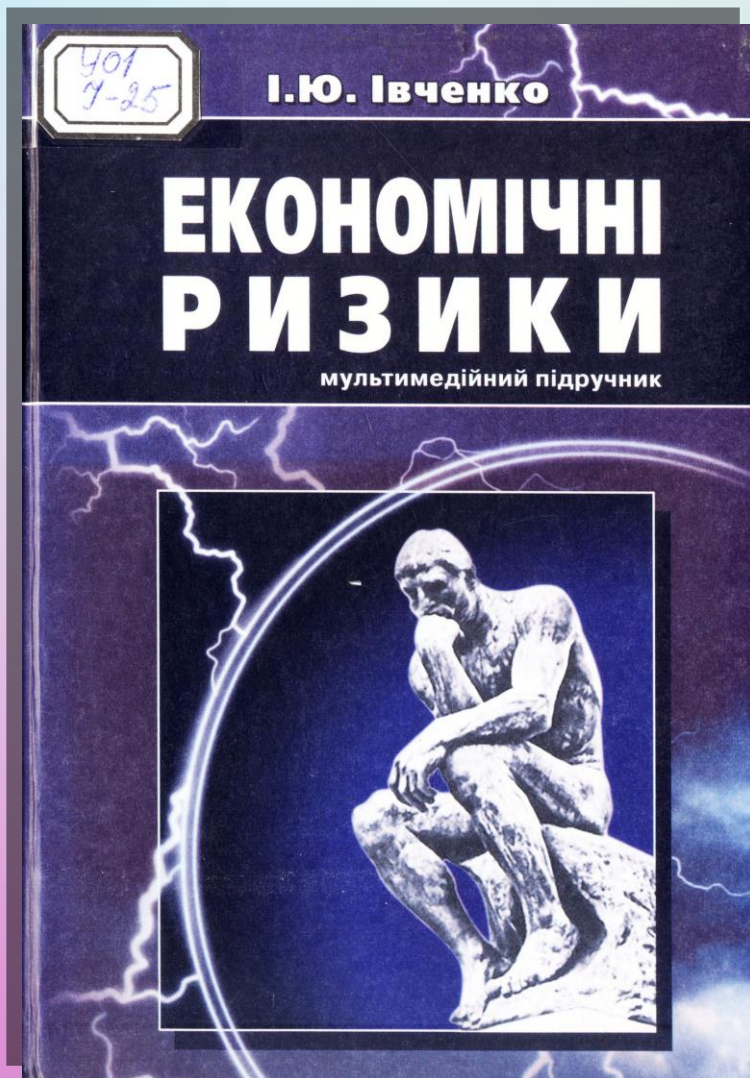
У навчальному посібнику викладено теоретичні аспекти та методологічні засади технології процесу розробки, прийняття рішень та основ сучасної економічної ризикології. Також розглянуто проблеми оцінки, врахування й управління ризиками як складового елементу теорії та практики обґрунтування господарських рішень.

Посібник призначено для студентів економічних спеціальностей вузів. Може бути корисним також економістам широкого профілю, менеджерам і всім, хто цікавиться проблемами ризикології та прийняттям ефективних господарських рішень.

У01

І-25 Івченко І. Ю.

Економічні ризики [Електронний ресурс] : [мультимедійний підручник] : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / І. Ю. Івченко. – К. : Центр навчальної літератури, 2004. – 301 с. : іл. + компакт-диск.



До вашої уваги пропонується потужний навчальний комплекс курсу “Економічні ризики”, який складається з друкованого і мультимедійного компонентів.

Запропонований матеріал відпрацьований у навчальному процесі серед студентів стаціонарної і заочної форм навчання на економічних спеціальностях і добре зарекомендував себе як у засвоєнні теоретичного матеріалу, так і в розв’язанні практичних задач. Система вправ і тренажерів дає тому, хто навчається, можливість самостійної об’єктивної оцінки отриманих знань і навичок.

Вміння вчасно оцінювати виникаючі ризики в ситуації невизначеності сучасного економічного середовища дозволяє швидко й ефективно приймати адекватні управлінські рішення у сфері економіки, бізнесу і фінансової діяльності.

Підручник призначений для студентів економічних спеціальностей вищих навчальних закладів, слухачів шкіл бізнесу, підприємців, керівників підприємств (організацій), менеджерів, фахівців страхових і кредитних організацій.

У526

В68 Волошин И. В.

Оценка банковских рисков : новые подходы / И. В. Волошин. – К. : Эльга ; Ника-Центр, 2004. – 215 с. : ил.

И.В.Волошин

**ОЦЕНКА
БАНКОВСКИХ
РИСКОВ:**
НОВЫЕ ПОДХОДЫ



Эльга • Ника-Центр

В книге обобщен опыт работы в банковской сфере. Она основана на оригинальных публикациях автора, которые появились в течение 1996-2003 гг.

Целью книги является освещение по возможности наиболее строгого количественного описания банковских рисков и методов их контроля. Книга требует от читателя базовых знаний по высшей математике.

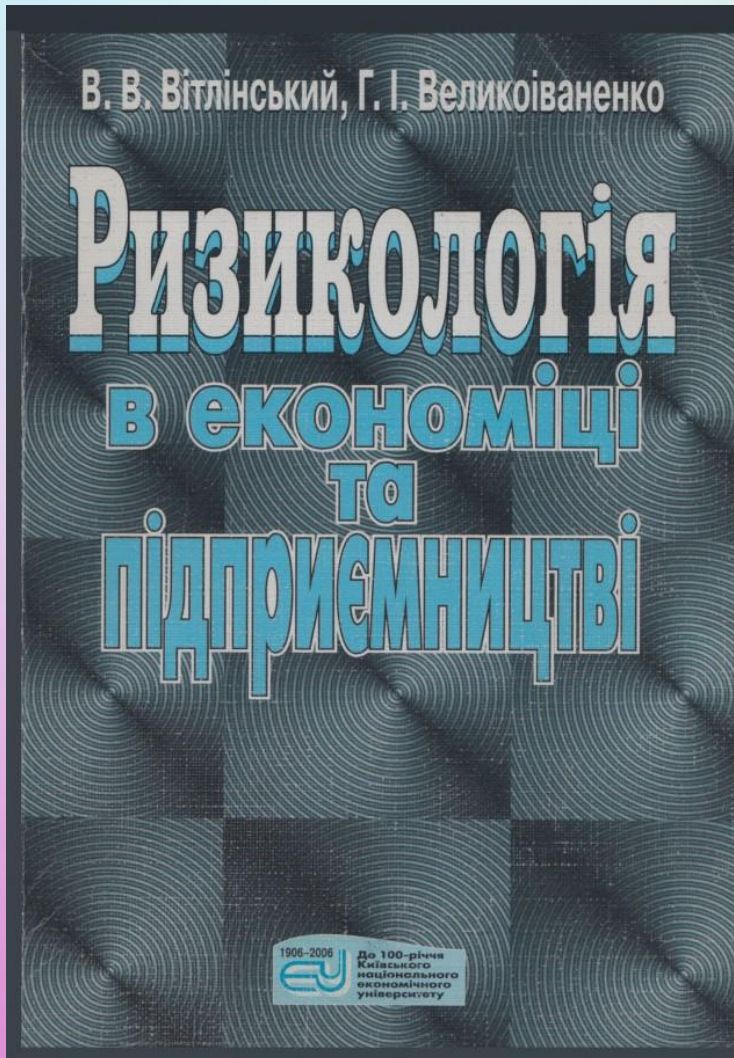
Рассмотрены риски мгновенной и срочной ликвидности, кредитный и процентный риски, модели ценообразования на биржах.

Представленный в книге материал будет полезен сотрудникам подразделений риск-менеджмента, аналитических служб, разработчикам программного обеспечения для банков, научным сотрудникам, преподавателям, аспирантам и студентам.

У01

В54 Вітлінський В. В.

Ризикологія в економіці та підприємництві : монографія /
В. В. Вітлінський, Г. І. Великоіваненко. – К. : КНЕУ, 2004. – 480 с. : іл.



Пропонована монографія присвячена науці про економічний ризик — ризикології. Автори трактують ризик як економічну категорію, що іманентно притаманна діяльності суб'єктів господарювання і пов'язана із сприйняттям і подоланням невизначеності, конфлікту в ситуаціях цілепокладання, оцінювання, управління, неминучого вибору. Ризик має діалектичну об'єктивно-суб'єктивну структуру. У монографії детально висвітлюються концептуальні аспекти ризикології — якісний та кількісний аналіз ризику, система показників його кількісного оцінювання, основні підходи до моделювання, управління та методів зниження ступеня ризику. Значна частина матеріалу публікується вперше.

Дана праця орієнтована на наукових працівників, аспірантів, викладачів і студентів з економічних спеціальностей вищих навчальних закладів, стане у пригоді практичного застосування фахівцями з економіки, фінансовими аналітиками та зацікавить усіх, хто бажає ознайомитися з цією проблематикою.

У01

М38 Машина Н. І.

Економічний ризик і методи його вимірювання : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / Н. І. Машина. – К. : Центр навчальної літератури, 2003. – 188 с. : іл.



У навчальному посібнику вміщено основні відомості про економічний ризик, його кількісну оцінку, вибір оптимальної стратегії в умовах ризику і методи керування ним. Матеріал кожного розділу містить необхідні теоретичні відомості, завдання для самостійної роботи, формулювання і приклади розв'язання типових задач.

Посібник призначено для студентів економічних спеціальностей вищих навчальних закладів. Може бути корисним економістам широкого профілю, менеджерам, працівникам інвестиційних фондів, банківських структур, страхових компаній і всім, хто цікавиться проблемами ризику.

У01

Г77 Гранатуров В. М.

Экономический риск : сущность, методы измерения, пути снижения : учеб. пособие / В. М. Гранатуров. – 2-е изд., перераб. и доп. – М. : Дело и сервис, 2002. – 159 с. : ил.



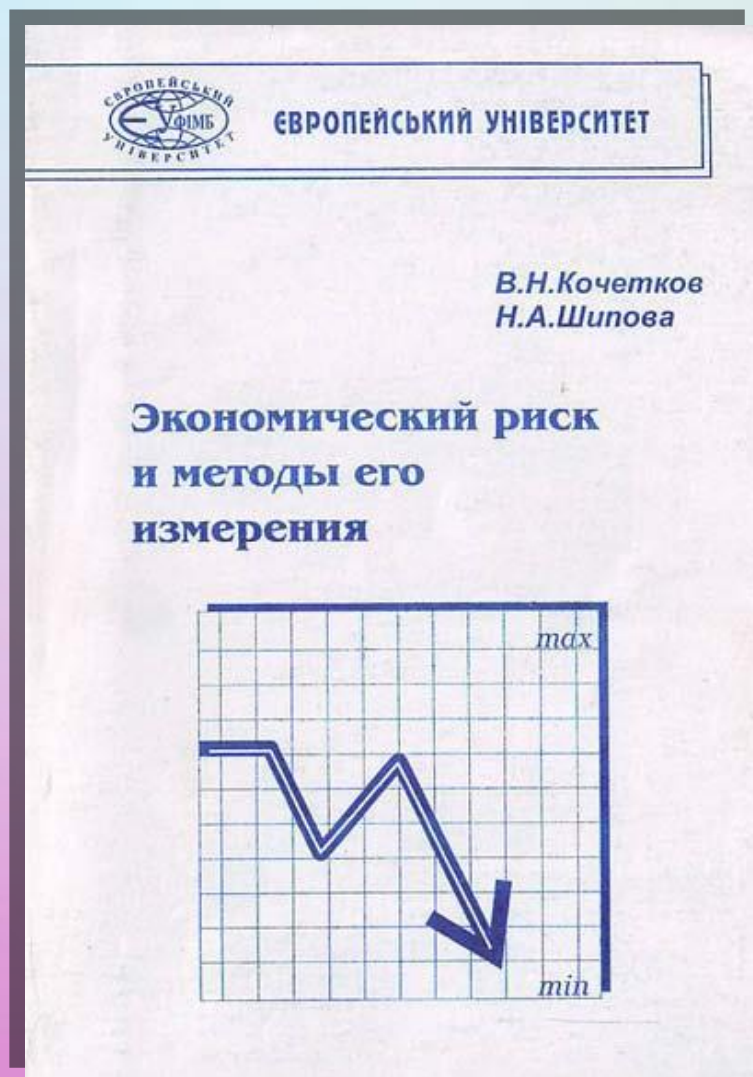
Излагается сущность экономического риска, его основные элементы и черты, причины возникновения. Представлены классификация и характеристики рисков, возникающих в различных сферах предпринимательской деятельности. Рассмотрены методы количественной оценки экономического риска, их использование при принятии управленческих решений, пути и методы предупреждения и снижения риска, особенности инвестиционной деятельности и их влияние на состав и содержание работ по анализу рисков инвестиционных проектов, методы анализа этих рисков в системе бизнес-планирования.

Издание предназначено для слушателей школ бизнеса, предпринимателей, руководителей предприятий (организаций), менеджеров, а также представляет интерес для преподавателей, аспирантов, студентов экономических специальностей высших учебных заведений.

У01

К75 Кочетков В. Н.

Экономический риск и методы его измерения : учеб. пособие / В. Н. Кочетков, Н. А. Шипова. – 2-е изд. – К. : Изд-во Европейского ун-та, 2003. – 67 с. : ил.



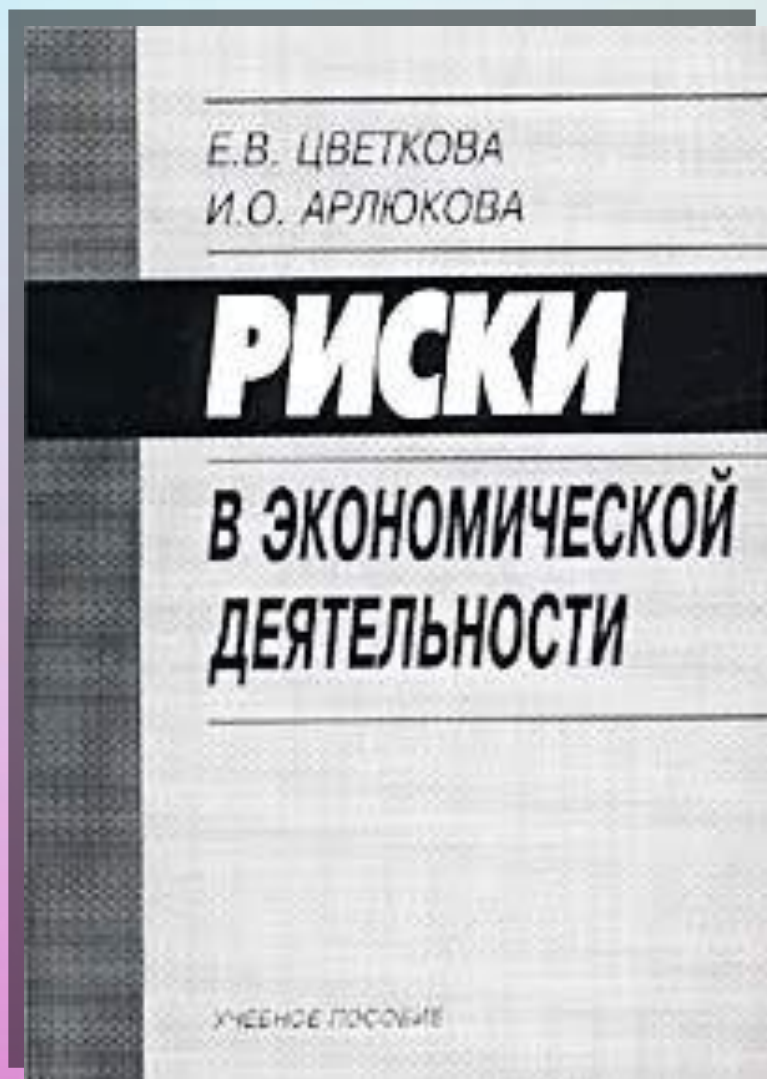
В книге изложен комплексный подход к количественной оценке и управлению экономическим риском. Рассмотрена сущность, причины возникновения и виды экономических рисков. Изложены методические основы анализа и оценки экономического риска.

Рассчитано на преподавателей и студентов финансово-экономических специальностей вузов, предпринимателей и деловых людей.

У01

Ц27 Цветкова Е. В.

Риски в экономической деятельности : учеб. пособие /
Е. В. Цветкова, И. О. Арлюкова. – СПб. : ИВЭСЭП ; Знание, 2002. –
64 с. : ил.



В книге осуществлен комплексный анализ рисков на базе положений макро- и микроэкономики. Выводы авторов апробированы в бизнес-деятельности и при проведении научных и профессиональных исследований.

Учебное пособие предназначено для студентов и всех, изучающих экономическую теорию и практические формы ее реализации.

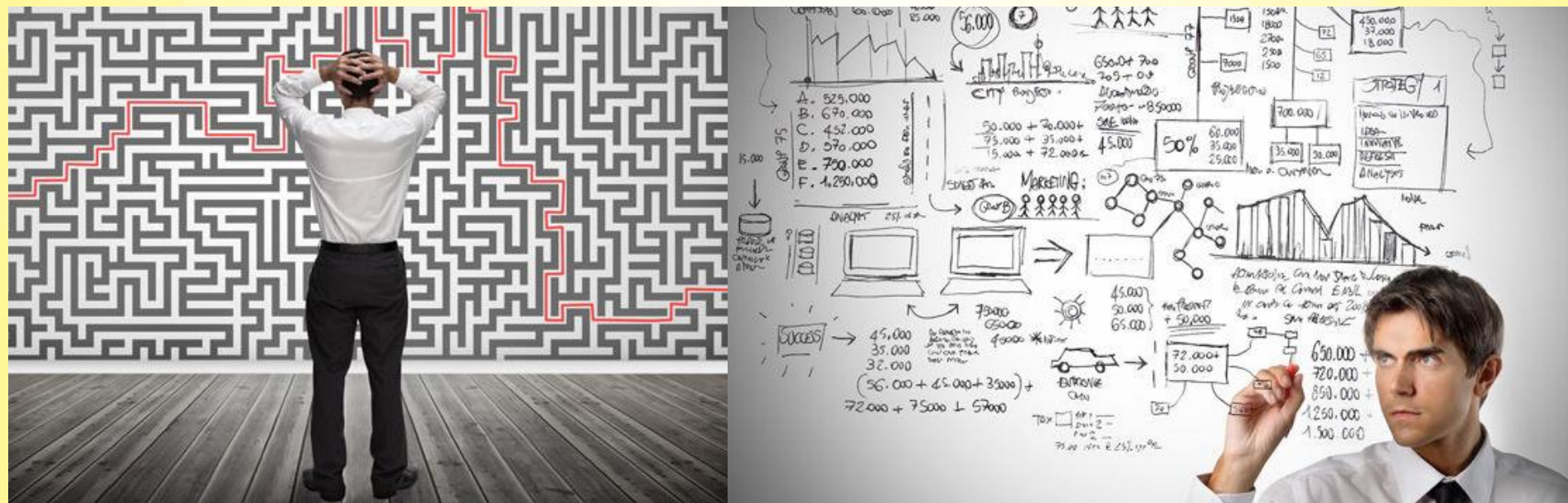
2. Моделирование рисковых ситуаций

- ✦ Для любого бизнеса важно не избежать риска вообще, а предвидеть его и принять наилучшее решение относительно определенного критерия, отражающего основной интерес предпринимателя.
- ✦ Теоретической основой и практическим инструментарием анализа и прогнозирования решений в экономике и бизнесе являются экономико-математические модели и проводимые по ним расчеты.
- ✦ В качестве математических средств принятия решений в условиях неопределенности и риска используются: теория стратегических игр, теория вероятностей, математическая статистика, теория статистических решений, математическое программирование, теория полезности Неймана-Моргенштерна.

Математическая модель оценки риска

$$R = f(x) = f(P, I),$$

- где, R – значение оценки последствий рискового события;
 $f(x)$ – функция параметра x (дохода, прибыли, ущерба, потерь, срока и т.п.);
 P – вероятность наступления рискового события;
 I – потенциальные последствия фактора риска.



У01

Ш23 Шапкин А. С.

Теория риска и моделирование рискованных ситуаций : учебник для студ. вузов, обуч. по спец. "Математические методы в экономике" / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. – 2-е изд. – М. : ИТК"Дашков и К", 2007. – 880 с. : ил.

В учебнике излагается сущность неопределенности и риска, классификация и факторы, действующие на них; приводятся методы качественной и количественной оценки экономических и финансовых ситуаций в условиях неопределенности и риска.

Дается классификация сервисных технологий, рассматриваются примеры деятельности сервисных организаций в рискованных ситуациях.

Излагается методика управления инвестиционными проектами в условиях риска, даются рекомендации по управлению портфелем инвестиций, проводится оценка финансового состояния и перспектив развития объекта инвестирования, предлагается модель учета рисков в инвестиционных проектах.

Значительное внимание уделяется методам и моделям управления в условиях риска и психологии поведения и оценки лица, принимающего решение.

Для студентов и аспирантов экономических вузов и факультетов, слушателей бизнес-школ, риск-менеджеров, менеджеров инноваций, инвестиций, а также специалистов банковских и финансовых структур, работников пенсионных, страховых и инвестиционных фондов.



У01

Д64 Долматов А. С.

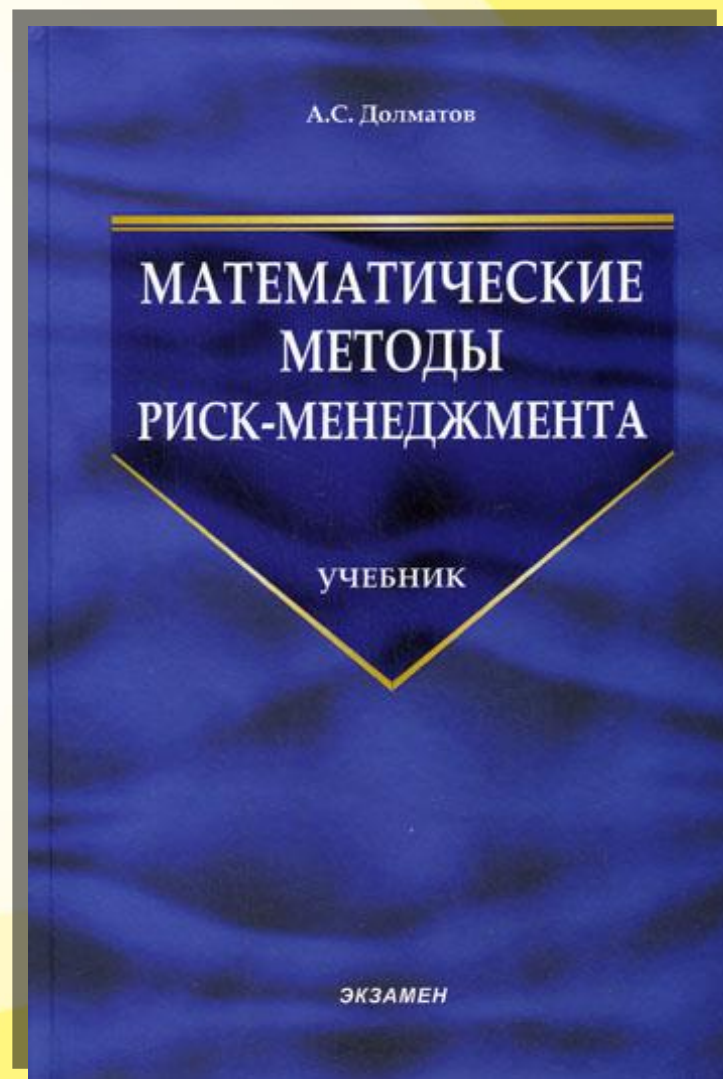
Математические методы риск-менеджмента : учеб. пособие для студ., обуч. по спец. "Финансы и кредит" / А. С. Долматов. – М. : Экзамен, 2007. – 320 с. : ил. + прил. – (Учебник для вузов).

Учебник посвящен основным аспектам проблемы измерения рыночных рисков. Материал, включенный в пособие, охватывает набор аналитических и численных методов, составляющих широко распространенную среди финансовых аналитиков методику Value-at-Risk (VaR), которая используется для оценки возможных потерь рыночной стоимости портфеля ценных бумаг.

Рассматриваются вопросы выбора вектора ключевых рисков факторов, влияющих на стоимость портфеля, определения параметров вероятностного распределения вектора ключевых рисков факторов, конструирования функции стоимости портфеля ценных бумаг, выбора и применения наиболее подходящего метода для расчета величины VaR, применения методов приближения функций для целей упрощения расчетов.

Также рассматриваются методика SPAN и методика биржи EUREX, предназначенные для оценки рыночных рисков портфелей производных финансовых инструментов.

Для студентов, магистрантов и аспирантов экономических специальностей высших учебных заведений, а также финансовых аналитиков, риск-менеджеров, трейдеров.

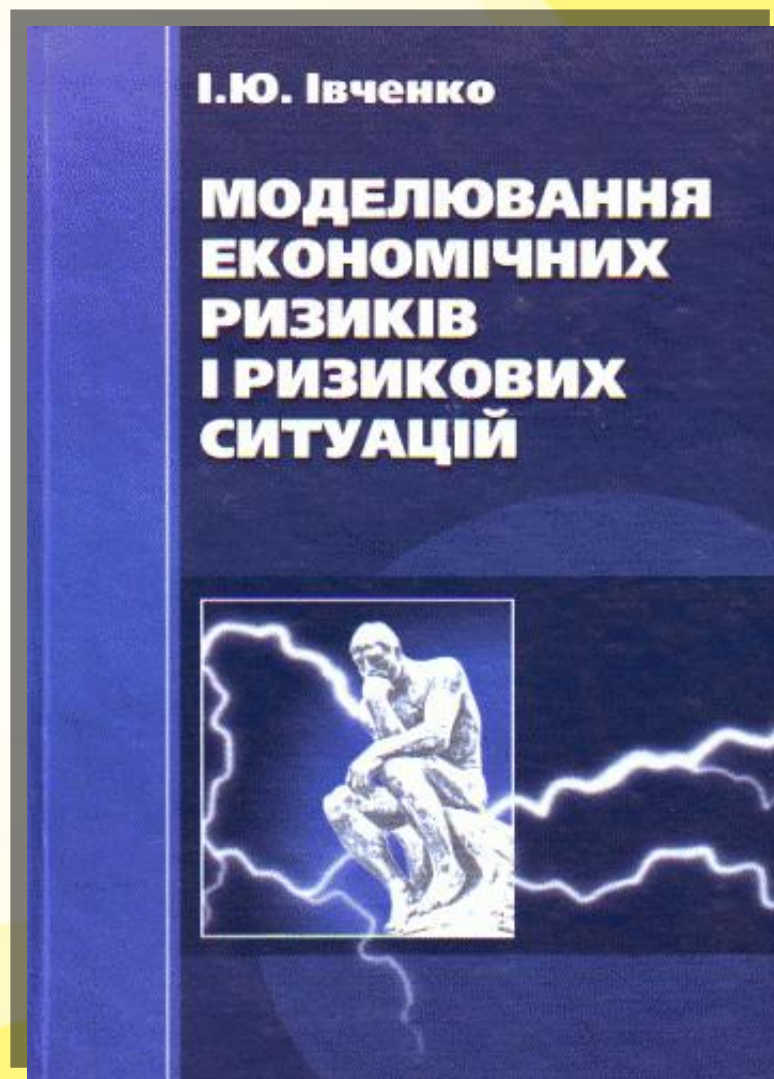


**Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій :
навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / І. Ю. Івченко. – К. :
Центр учбової літератури , 2007. – 344 с. : іл.**

У навчальному посібнику «Моделювання економічних ризиків і ризикових ситуацій» викладено сутність, класифікацію і характеристики економічних ризиків. Подано методи оцінки ризиків і способи вибору з наявних альтернатив оптимальних рішень. Розглянуто теорії статистичних і стратегічних ігор та можливості їх застосування для прийняття рішень в умовах невизначеності. Наведено практичні приклади і рекомендації з аналізу, обліку і керування ризиками.

Посібник гармонійно об'єднує теоретичний матеріал і практичні економічні завдання. Для набуття практичних навичок у даній предметній галузі в підручнику розглянуто чимало тематичних прикладів та задач. Крім того, у підручнику передбачена можливість закріплення отриманих знань за допомогою тестових питань.

Підручник призначений для студентів економічних спеціальностей вищих навчальних закладів, слухачів шкіл бізнесу, підприємців, керівників підприємств (організацій), менеджерів, фахівців страхових і кредитних організацій.



У01

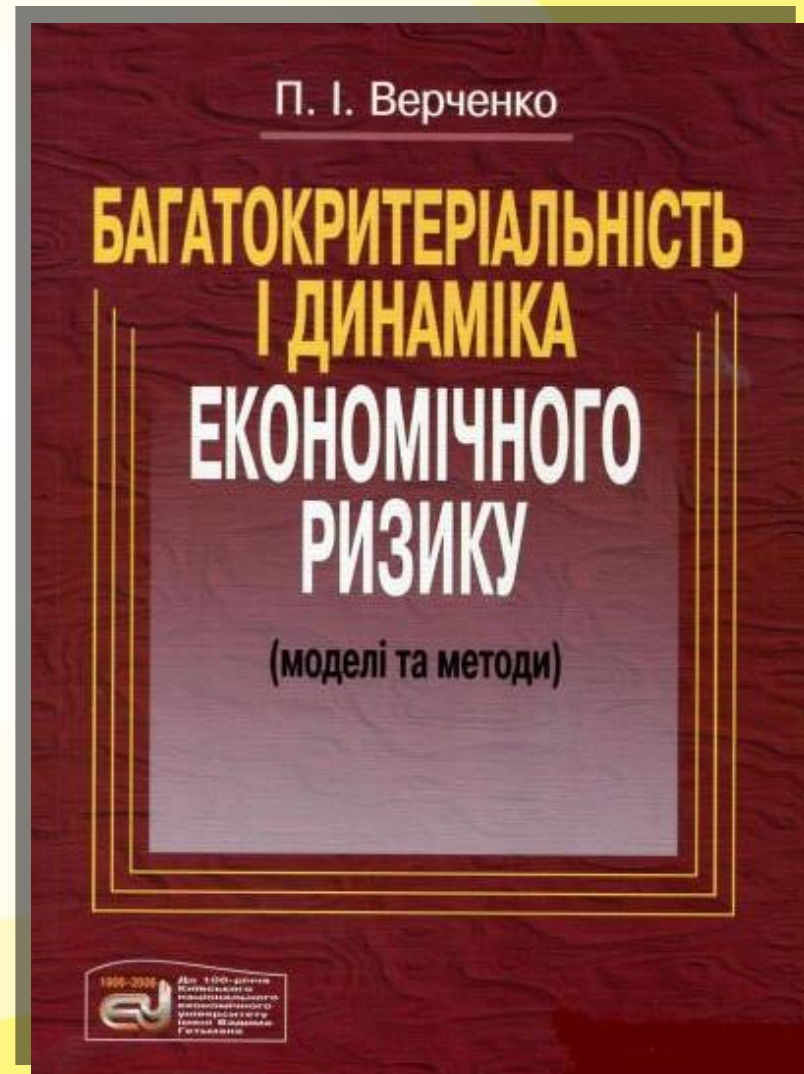
В36 Верченко П. І.

Багатокритеріальність і динаміка економічного ризику : моделі та методи : монографія / П. І. Верченко. – К. : КНЕУ, 2006. – 265 с. : іл.

Монографія присвячена подальшому розвитку такого нового напрямку в економічній науці, як економічна ризикологія. Власне, таких аспектів дослідження економічного ризику, як його багатокритеріальність та динаміка. Проблеми, яких торкається автор, тісно пов'язані з моделюванням економічних процесів обґрунтування прийняття рішень, обтяжених невизначеністю та конфліктністю щодо внутрішнього стану економічного об'єкта і зовнішнього (економічного) середовища, цілепокладання тощо.

Альтернативні рішення пропонується аналізувати з позиції багатьох цілей та з використанням багатьох критеріїв (так звана багатоцільова багатокритеріальна модель) як у статичній, так і в динамічній системі. Аналізується низка проблем, що виникають у процесі реалізації цієї методики.

Підходи, що розвиваються в монографії, можуть зацікавити наукову спільноту, яка переймається проблемами економіко-математичного моделювання, викладачів, аспірантів та магістрів економічних вузів.



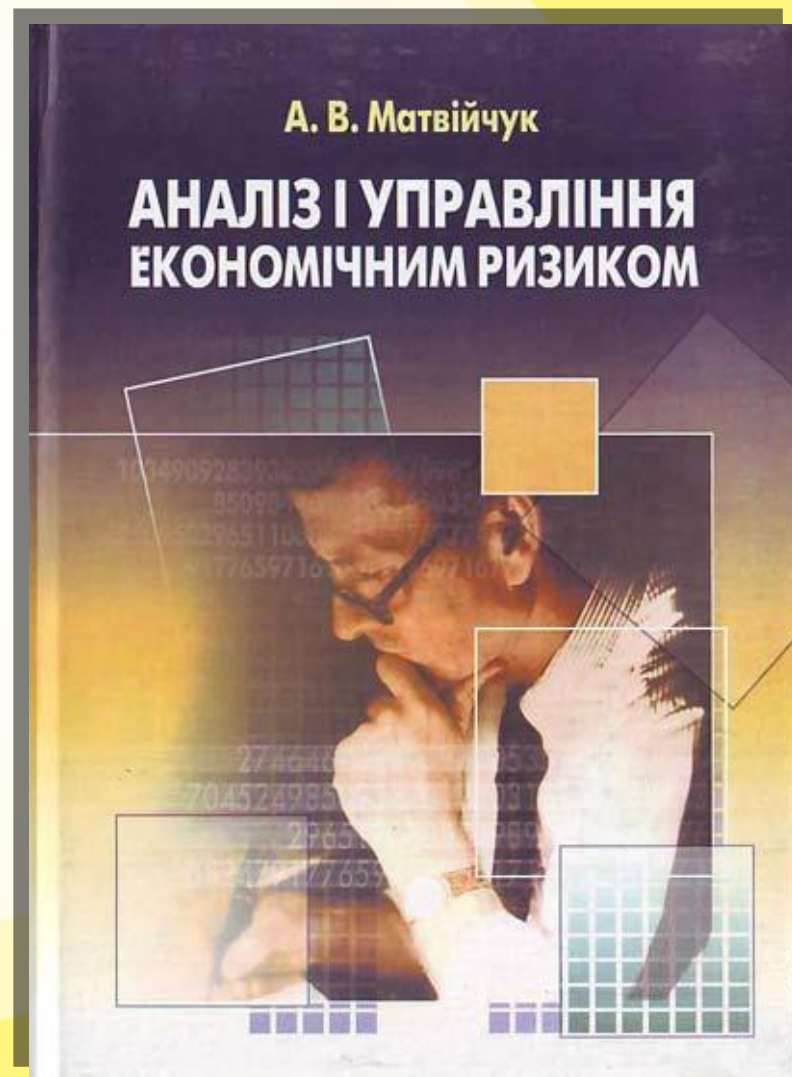
У01

МЗЗ Матвійчук А. В.

Аналіз і управління економічним ризиком : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / А. В. Матвійчук. – К. : Центр навчальної літератури, 2005. – 224 с. : іл.

В навчальному посібнику розкривається сутність проблеми побудови математичних моделей аналізу, прогнозування та управління фінансово-економічними системами в умовах невизначеності та ризику. Представлено різні підходи до якісної та кількісної оцінки економічних ризиків, управління портфелем цінних паперів, запропоновано методики прогнозування фінансових часових рядів із використанням адаптивних регресійних моделей та нейронних мереж. Показані методики проведення комплексного аналізу фінансового стану, діагностики банкрутства підприємства на основі апарату нечіткого логічного висновку.

Навчальний посібник розрахований на студентів, аспірантів та наукових працівників, які цікавляться економічною ризикологією, фінансовим аналізом та методами прогнозування економічних показників.

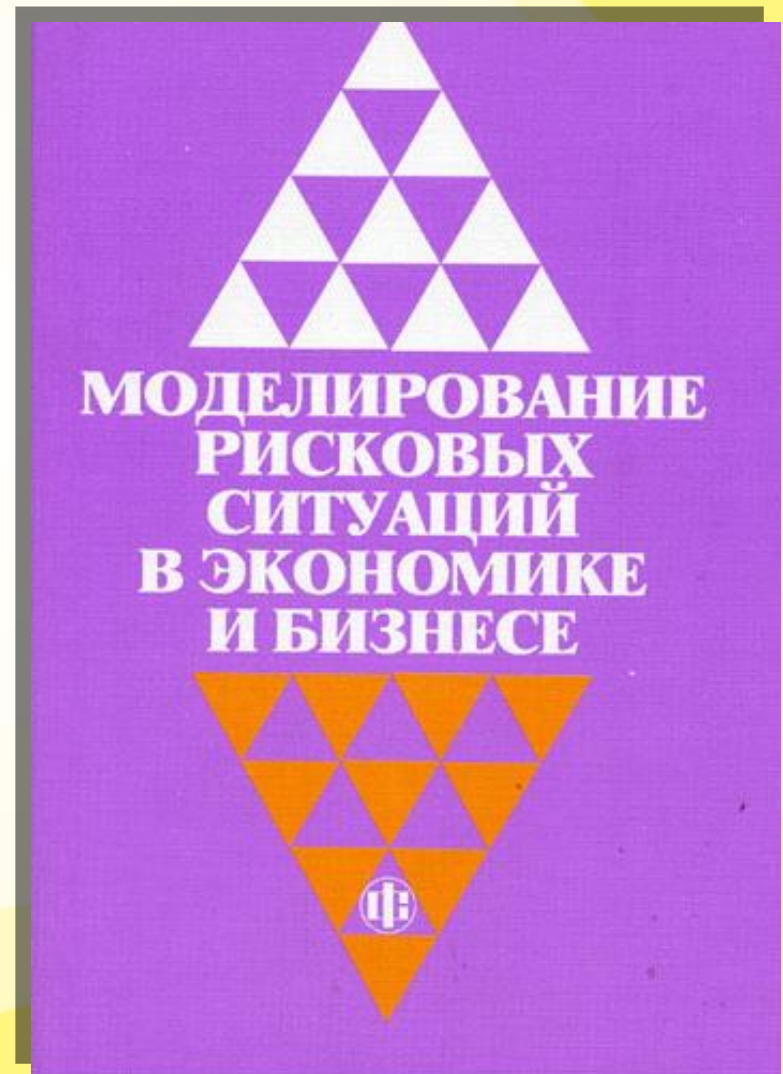


У01

М74 Моделирование рискованных ситуаций в экономике и бизнесе : учеб. пособие для студ. вузов, обуч. по спец. "Статистика", "Математические методы в экономике", "Прикладная информатика (по областям)" / А. М. Дубров, Б. А. Лагоша, Е. Ю. Хрусталева, Т. П. Барановская ; под ред. Б. А. Лагоши. – 2-е изд., перераб. и доп. – М. : Финансы и статистика, 2003. – 224 с. : ил. + прил.

Рассматриваются подходы к учету факторов неопределенности и риска в экономической практике, а также математические модели, используемые для этих целей. Анализируются ситуации, возникшие в условиях неопределенности и недостатка информации при принятии управленческих решений. В отличие от 1-го издания (1999 г.) увеличено количество примеров с решениями, переработан ряд разделов и добавлены новые.

Для студентов, обучающихся по специальностям «Статистика», «Математические методы и исследование операций в экономике», «Информационные системы в экономике» и другим специальностям. Для аспирантов, преподавателей, предпринимателей.



У01

Е40 Економічний ризик : ігрові моделі : навч. посібник /

В. В. Вітлінський, П. І. Верченко, А. В. Сігал, Я. С. Наконечний ; за ред.
В. В. Вітлінського. – К. : КНЕУ, 2002. – 446 с. : іл.

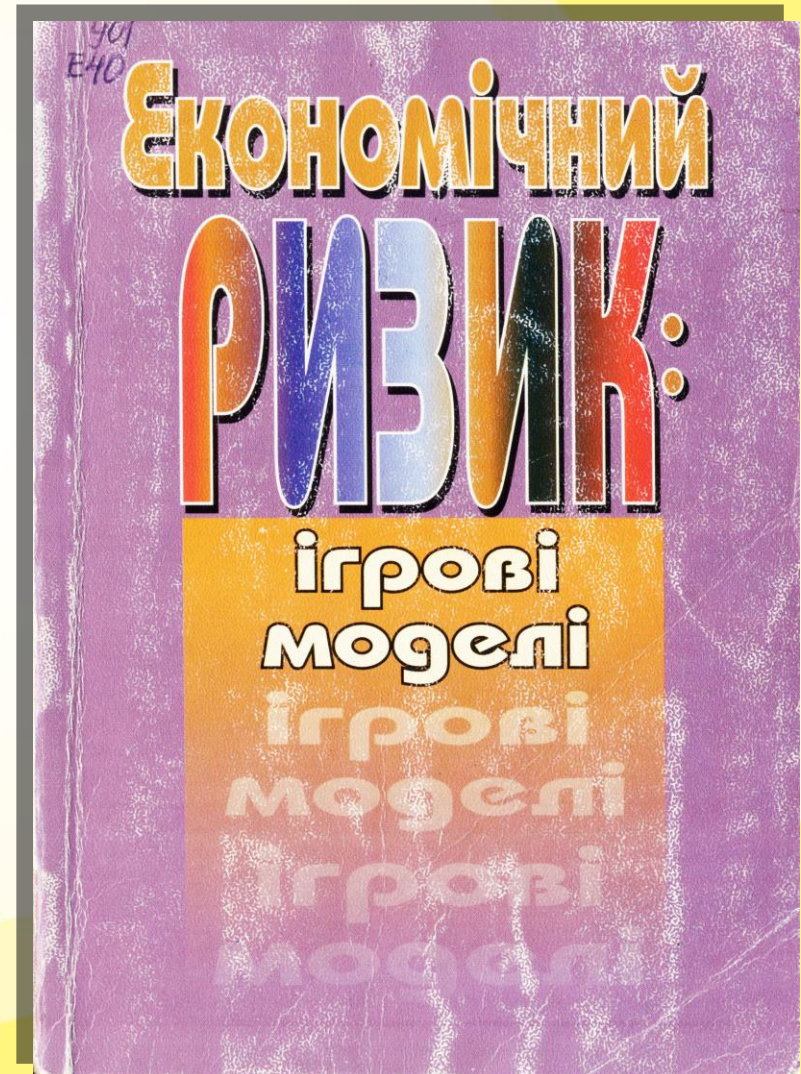
У навчальному посібнику розкривається сутність ризику у широкому спектрі задач, що виникають в економічній діяльності та підприємстві. Досліджуються способи та інструментарій вибору раціональної стратегії з множини альтернативних варіантів з урахуванням ризику.

Ризик трактується як об'єктивно-суб'єктивна економічна категорія у діяльності суб'єктів господарювання. Він пов'язаний з подоланням невизначеності та конфлікту в ситуації оцінювання, управління та неминучого вибору.

Задачі аналізу, оцінювання та прийняття рішень в умовах ризику розглядаються на підґрунті концептуальних положень і формалізованих моделей реальних економічних ситуацій під назвою «Теорія гри і рішень».

Детально висвітлюються питання ризикології – якісного та кількісного аналізу ризику, система його кількісних показників, основні засади моделювання та управління ризиком. Значна увага приділяється багатоцільовим і багатокритеріальним ігровим моделям. Описується інструментарій, необхідний для аналізу, прийняття рішень і раціонального управління об'єктом ризику в низці господарських задач.

Навчальний посібник розрахований насамперед на студентів вищих навчальних закладів усіх спеціальностей з напрямом «Економіка і підприємство», котрі вивчають дисципліну «Аналіз моделювання та управління економічним ризиком», а також на аспірантів, слухачів системи закладів післядипломної освіти, широке коло фахівців економічної й управлінської сфер і підприємств.

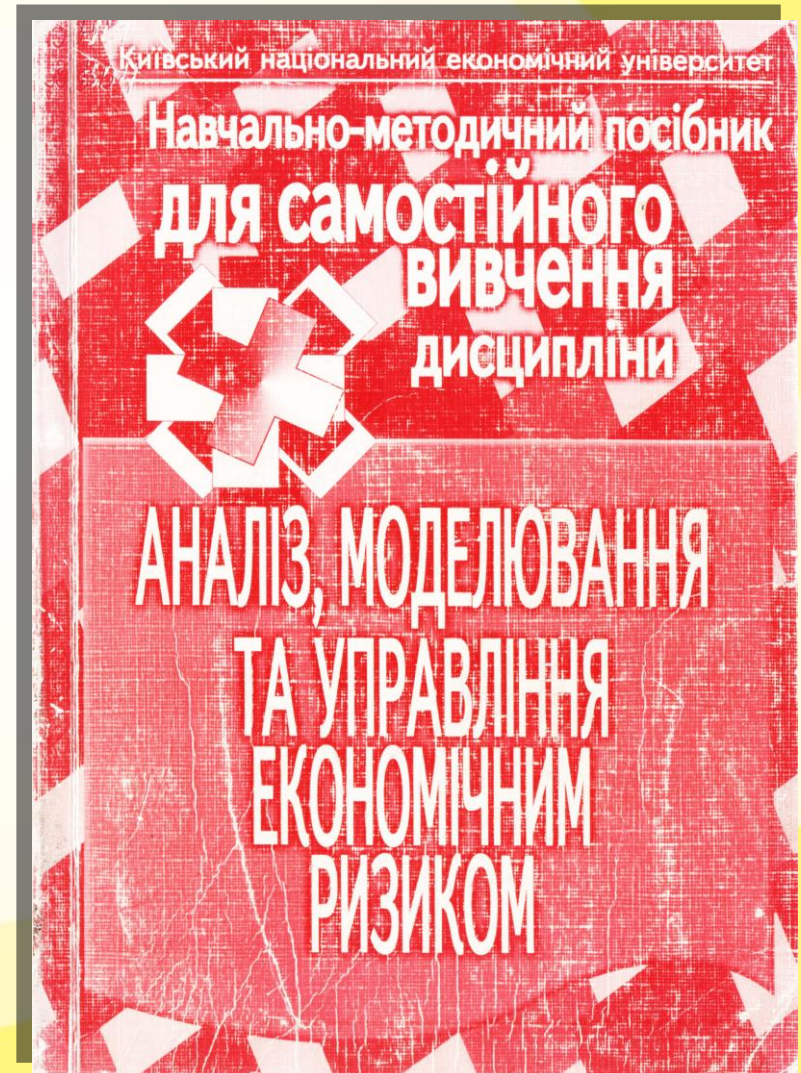


Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком : навч.-метод. посібник для самостійного вивчення дисципліни / В. В. Вітлінський, П. І. Верченко. – К. : КНЕУ, 2000. – 292 с. : іл. + додатки.

У посібнику розглядаються принципи і методи системного аналізу, моделювання та управління економічним ризиком суб'єктів господарювання, що має велике значення для прийняття правильних рішень під час розв'язання тих чи інших економічних проблем. Значну увагу приділено деяким новим, розробленим авторами, концептуальним засадам та інструментарію економічної ризикології.

Теоретичний матеріал ілюструється числовими прикладами, представлено їх аналіз і шляхи розв'язання. Наприкінці кожного розділу подаються запитання для самоконтролю, пропонуються приклади для самостійного розв'язання, тематика рефератів тощо.

Для студентів економічних спеціальностей вузів, аспірантів, викладачів, широкого кола фахівців, які цікавляться економічною ризикологією.



3. Управление рисками (риск-менеджмент)

- **Управление рисками - это процессы, связанные с идентификацией, анализом рисков и принятием решений, которые включают максимизацию положительных и минимизацию отрицательных последствий наступления рискованных событий.**
- **Риск-менеджмент представляет собой систему управления риском и экономическими (финансовыми) отношениями, возникающими в процессе этого управления, включая в себя стратегию и тактику управления риском.**

Управление рисками

Риск-маркетинг

Риск-целеполагание

планирование

мотивация

Риск-менеджмент

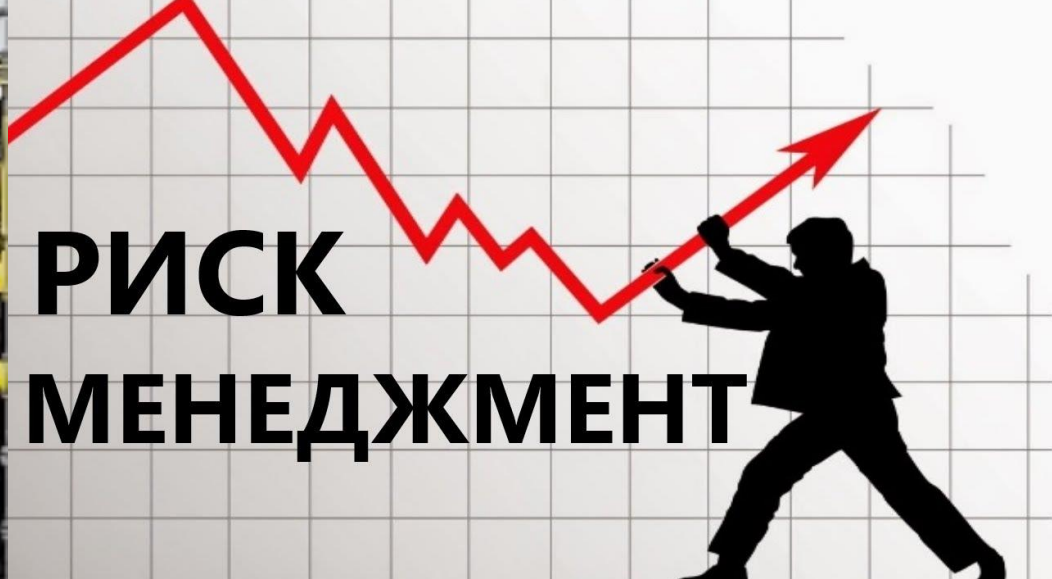
контроль

организация

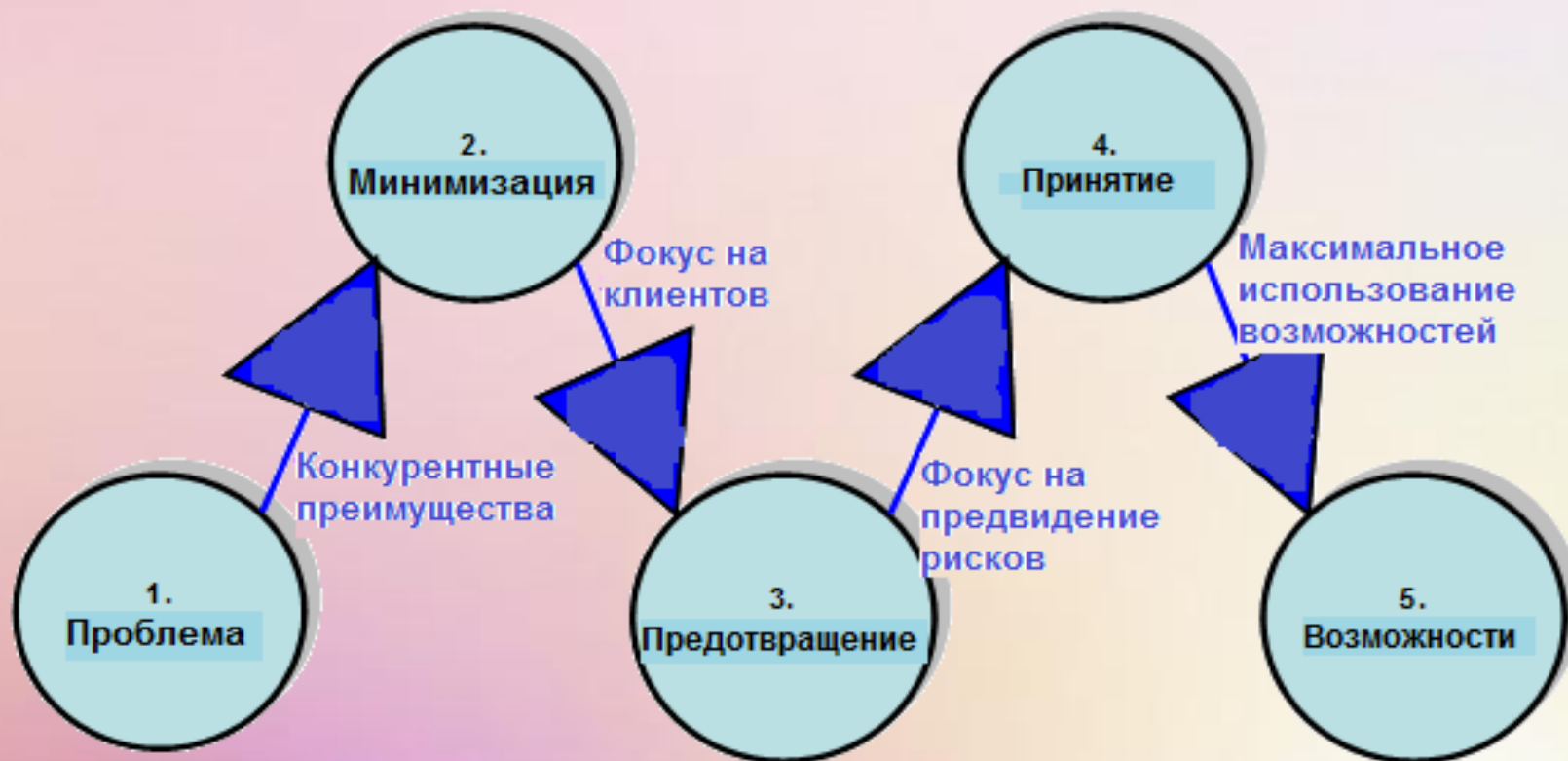


Этапы управления рисками





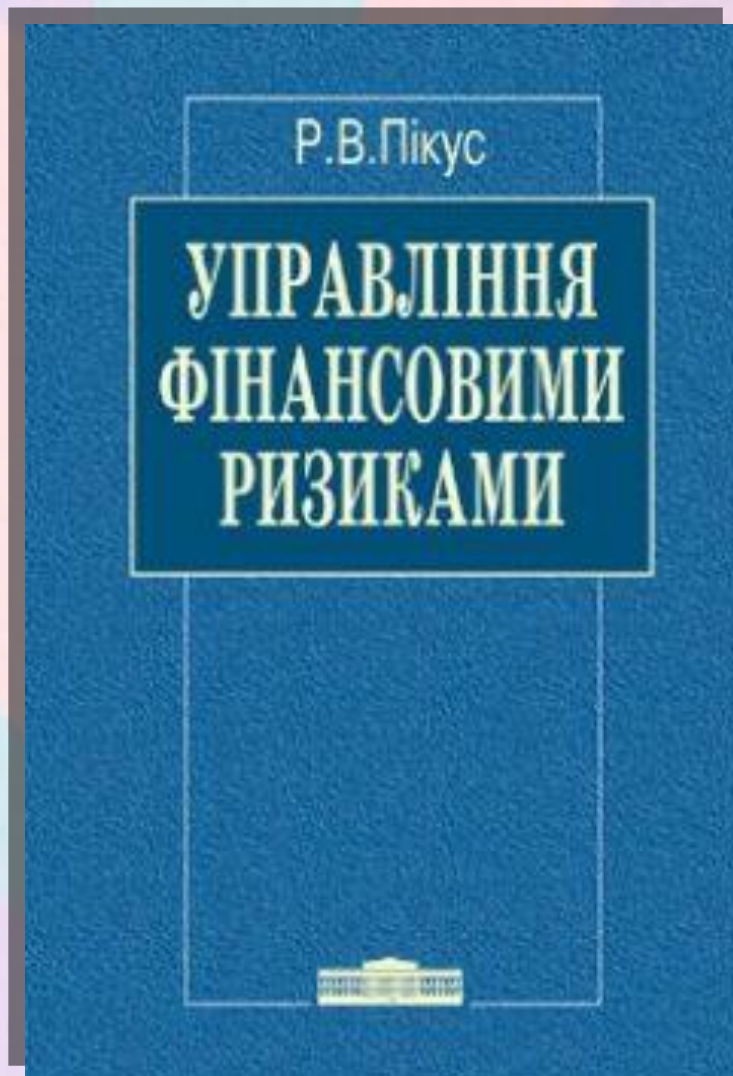
РИСК МЕНЕДЖМЕНТ



У5

ПЗ2 Пікус Р. В.

Управління фінансовими ризиками : навч. посібник /
Р.В. Пікус. – К. : Знання, 2010. – 599 с. : іл.



Це перший в Україні фундаментальний навчальний посібник, у якому ґрунтовно розкриваються теоретичні засади і найважливіші сторони управління фінансовими ризиками в сучасних умовах. Зокрема, розглядаються політико-економічний ризик в системі ризик-менеджменту, управління інвестиційними ризиками, ризиком неплатоспроможності, кредитним ризиком, ризиком на іпотечному ринку, фінансовими ризиками у банківській діяльності, відсотковим ризиком, ризиком ліквідності, валютними ризиками та ризиками на ринку строкових угод.

Посібник устаткований необхідними таблицями, рисунками, схемами. Для самостійної роботи студентів до кожного розділу додається ретельно продуманий навчальний тренінг. У кінці книги наведено список рекомендованої літератури.

Для студентів, аспірантів і викладачів вищих навчальних закладів. Книга буде корисною також керівникам підприємств і організацій, фахівцям-практикам у галузі управління ризиками.

У01

С77 Старостіна А. О.

Ризик-менеджмент : теорія та практика : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів, які навч. за освітньо-професійною програмою спец. з напр. “Економіка і підприємництво” / А. О. Старостіна, В. А. Кравченко. – К. : Кондор ; Політехніка, 2009. – 200 с. : іл. + додатки.



Розглянуто суть ризик-менеджменту, його місце в діяльності підприємств і практичні аспекти аналізу ризиків на підприємстві загалом та в різних його підрозділах, а також можливості ризик-менеджменту для підвищення ефективності маркетингової діяльності. Викладено особливості використання спеціальних комп'ютерних програм (CristalBall 2000 та @Risk) для ризик-аналізу інвестиційних і маркетингових проектів. Показано специфіку вивчення ризиків споживача.

Для студентів економічних спеціальностей.

У01

Г65 Гончаренко Л. П.

Риск-менеджмент : учеб. пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин ; под ред. Е. А. Олейникова. – 3-е изд., стер. – М. : Кнорус, 2008. – 216 с. : ил.



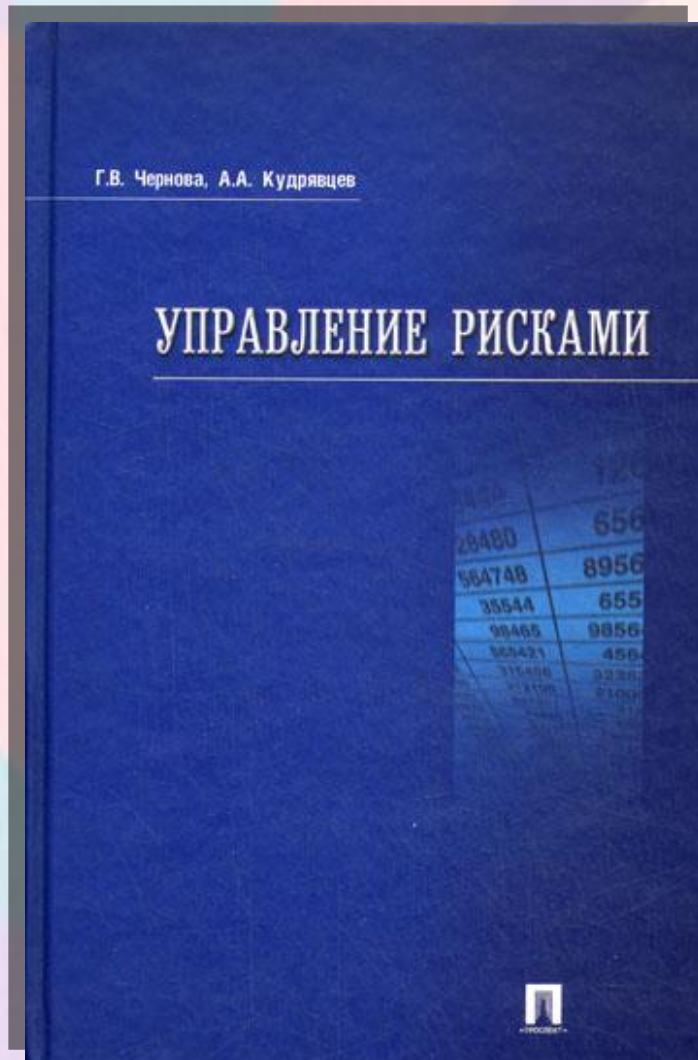
Материал, представленный в учебном пособии, знакомит читателя с основными понятиями и проблемами оценки и нейтрализации рисков в предпринимательской деятельности. На основе данных отраслевых статистических справочников приводятся методики по расчетам рисков, учитывая различные виды предпринимательской деятельности.

Для студентов экономических специальностей очной, заочной и дистанционной форм обучения, специалистов-практиков, а также для читателей, заинтересованных в овладении теоретическими и практическими навыками работы в бизнесе.

У01

Ч-49 Чернова Г. В.

Управление рисками : учеб. пособие для студ. вузов, обуч. по спец. "Финансы и кредит", "Бухгалтерский учет, анализ и аудит", "Мировая экономика" / Г. В. Чернова, А. А. Кудрявцев. – М. : Проспект, 2008. – 158 с. : ил.



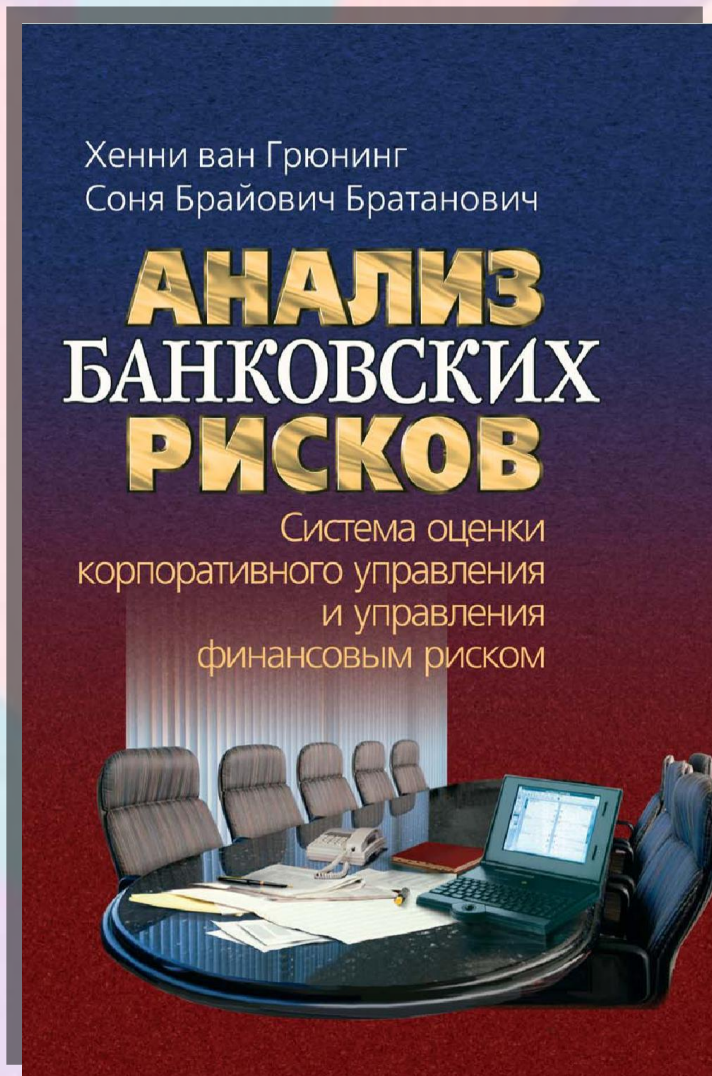
В учебном пособии подробно рассмотрены понятие "риск", классификация рисков, в том числе банковская и страховая, методы управления рисками. Отдельная глава посвящена практическим проблемам управления рисками. Подробно изложены вопросы управления рисками на уровне отдельной фирмы. Каждая глава сопровождается материалами для самостоятельной работы.

Для преподавателей, студентов, научных работников, аспирантов экономико-математических специальностей, практиков-профессионалов (финансовых директоров, аналитиков, финансово-плановых работников, разработчиков систем управления финансами).

У526

Г92 Грюнинг Хенни ван

Анализ банковских рисков : система оценки корпоративного управления и управления финансовым риском : пер. с англ. / Хенни ван Грюнинг, Соня Брайович Братанович. – М. : Весь мир, 2007. – 290 с. : ил. + прил.



В исследовании сотрудников Всемирного банка анализируются всевозможные риски, которым подвергаются в процессе своей деятельности банки, в том числе кредитный, рыночный, процентный, валютный, риск ликвидности и др. Предлагается схема всесторонней оценки банка на основе не только финансовой, но и управленческой информации. В качестве инструментов для диагностики банковских проблем используются специально разработанные таблицы, графики и диаграммы. Особое внимание в книге уделяется принципам управления риском и взаимосвязям между различными категориями риска.

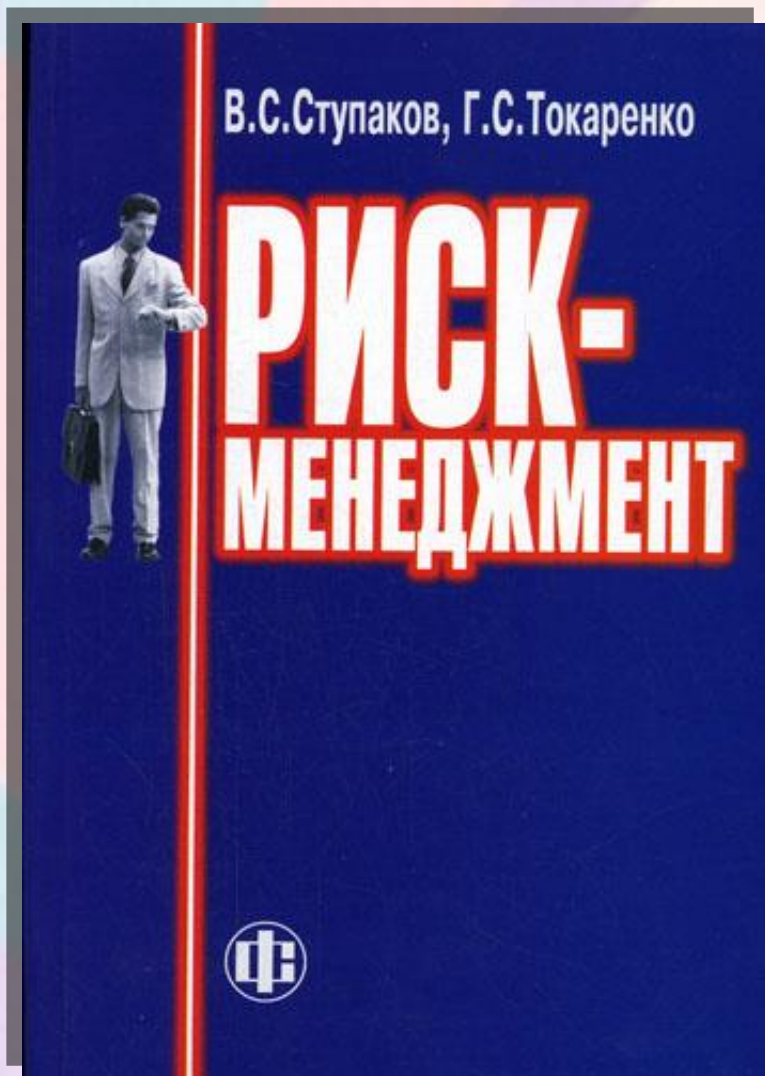
Книга предназначена в первую очередь специалистам по анализу риска и банковскому надзору, а также широкому кругу пользователей банковской информации.

Книга издана в рамках совместной издательской программы с институтом «Банковское и страховое дело» РЭА им. Плеханова.

У01

С88 Ступаков В. С.

Риск-менеджмент : учеб. пособие для студ. вузов, обуч. по спец. "Финансы и кредит" / В. С. Ступаков, Г. С. Токаренко. – М. : Финансы и статистика, 2006. – 284 с. : ил.



Рассмотрены основные понятия и определения риск-менеджмента, причины, факторы, показатели, модели и методы оценки риска. Разработаны концепция и технология риск-менеджмента, установлены правила принятия рискового решения и раскрыты средства и приемы снижения предпринимательского риска. В пособии приведено большое количество практических примеров.

Для студентов, обучающихся по специальности "Финансы и кредит", а также специалистов, занимающихся исследованиями по широкому спектру вопросов риск-менеджмента в предпринимательстве.

У5

Б68 Бланк И. А.

Управление финансовыми рисками : учебный курс /
И. А. Бланк. – К. : Ника-Центр, 2006. – 446 с. : ил.



В данном учебном курсе рассматривается основной круг вопросов управления финансовыми рисками предприятия в современных условиях. В ней изложен теоретический базис финансового риск-менеджмента, сформулированы сущность, цель и функции управления финансовыми рисками предприятия, рассмотрены его методологические системы и методический инструментарий. Книга знакомит с современными методами исследования систематических и несистематических финансовых рисков предприятия, механизмами их нейтрализации, особенностями управления этими рисками в операционной и инвестиционной деятельности. Изучаемый учебный курс широко иллюстрирован схемами, графиками, таблицами и примерами, содержит основные расчетные алгоритмы финансового риск-менеджмента и необходимый справочный аппарат.

Автор книги - заслуженный деятель науки, доктор экономических наук, профессор Бланк И. А., продолжительное время сочетает научную и преподавательскую работу по данной проблеме с практической деятельностью в качестве главного эксперта и консультанта ряда компаний.

Учебный курс рассчитан на студентов экономических ВУЗов.

У5

Б68 Бланк И. А.

Управление финансовыми рисками / И. А. Бланк. – К. : Ника-Центр, 2005. – 600 с. : ил. + прил. – (Библиотека финансового менеджера).



В книге рассматривается основной круг вопросов управления финансовыми рисками предприятия в современных условиях. В ней изложен теоретический базис финансового риск-менеджмента, сформулированы сущность, цель и функции управления финансовыми рисками предприятия, рассмотрены его методологические системы и методический инструментарий. Книга знакомит с современными методами исследования систематических и несистематических финансовых рисков предприятия, механизмами их нейтрализации, особенностями управления этими рисками в операционной и инвестиционной деятельности. Книга широко иллюстрирована схемами, графиками, таблицами и примерами, содержит основные расчетные алгоритмы финансового риск-менеджмента и необходимый справочный аппарат.

Автор книги - заслуженный деятель науки, доктор экономических наук, профессор Бланк И. А. – продолжительное время сочетает научную и преподавательскую работу в области финансового менеджмента с практической деятельностью в качестве главного эксперта и консультанта ряда компаний.

Книга рассчитана на руководителей, финансовых и риск-менеджеров предприятий, преподавателей, аспирантов и студентов экономических вузов.

У01

Б20 Балдин К. В.

Управление рисками : учеб. пособие для студ. вузов, обуч. по спец. экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. – М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2005. – 512 с. : ил.



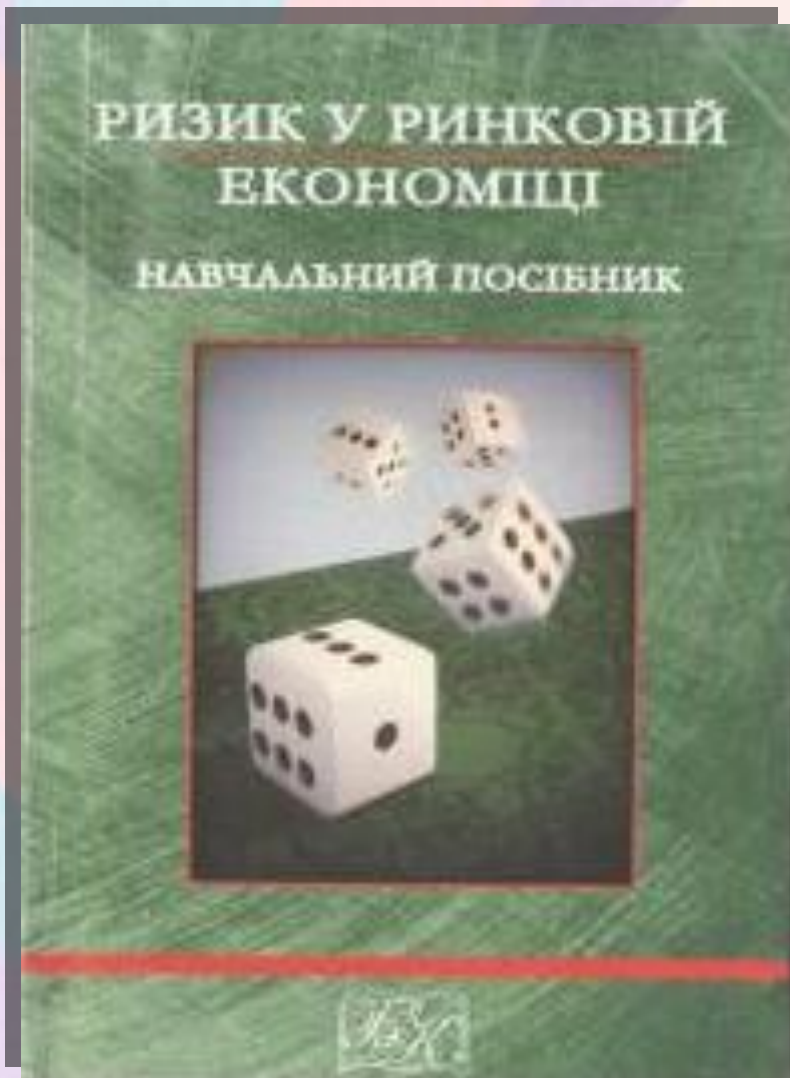
Рассмотрены методологические, организационные и технологические основы системного анализа, идентификации и управления рисками в экономике и управлении, в том числе в предпринимательстве, с использованием математических методов и моделей.

Для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления, сотрудников консалтинговых фирм и предпринимателей, занимающихся самостоятельной практикой системного анализа рисков в маркетинге.

У01

А65 Андрєєва Т. Є.

Ризик у ринковій економіці : навч. посібник для студ. вищих навч. закладів / Т. Є. Андрєєва, Т. Е. Петровська. – Харків : Бурун Книга, 2005. – 128 с. : іл.



Навчальний посібник містить теоретичні та практичні аспекти використання сучасної теорії управління ризиками: аналіз та виявлення ризику, механізм управління, організація попереджувальних заходів, приведена детальна класифікація ризиків, властивих підприємствам різних сфер діяльності.

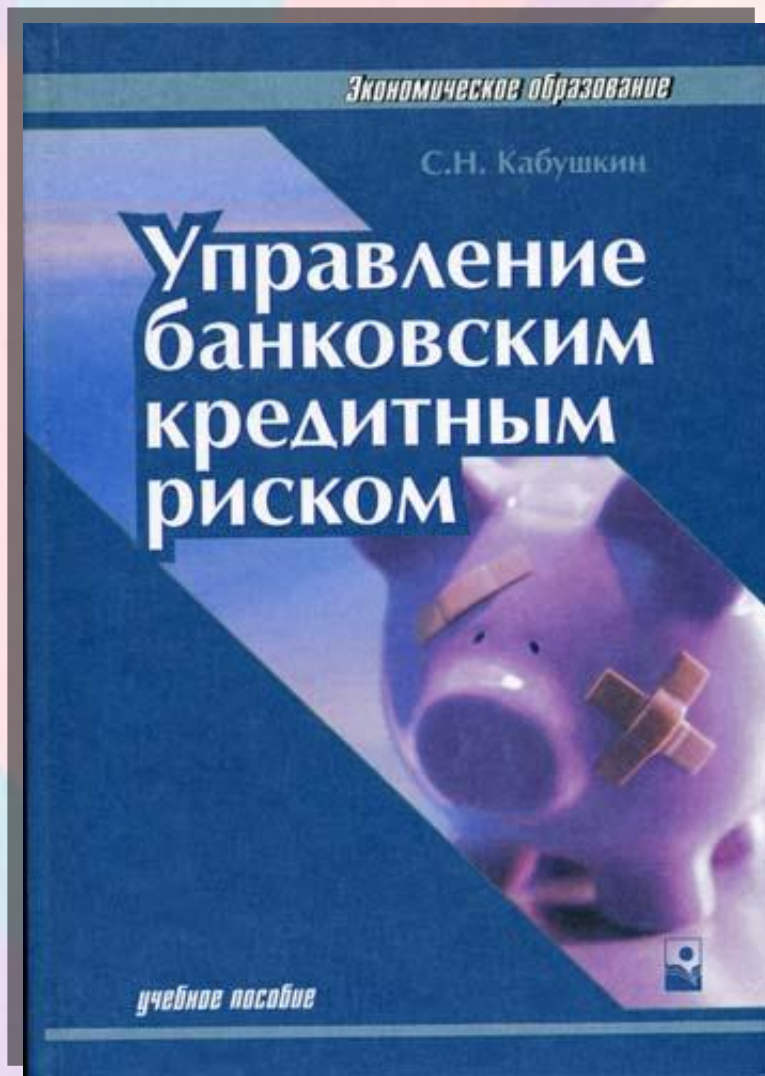
Навчальний посібник призначений для студентів спеціальності “Менеджмент організацій” всіх форм навчання.

Книга написана доступною мовою і може бути цікава широкому колу читачів.

У526

К12 Кабушкин С. Н.

Управление банковским кредитным риском : учеб. пособие / С. Н. Кабушкин. – 2-е изд., стер. – М. : Новое знание, 2005. – 336 с. : ил. + прил. – (Экономическое образование).



Обобщен мировой опыт управления банковскими рисками, учтены условия нашей действительности. Центральное место занимают проблемы предупреждения, анализа, оценки и минимизации кредитного риска. Особое внимание уделено вопросам управления банковскими рисками по методологии VaR. Рассмотрены методы страхования банковского кредитного риска.

Предназначено для студентов вузов, аспирантов и слушателей ИПК, изучающих банковское дело, руководителей и специалистов банков.

У01

Б26 Бартон Томас Л.

Комплексный подход к риск-менеджменту: стоит ли этим заниматься : пер. с англ. / Томас Л. Бартон, Уильям Г. Шенкир, Пол Л. Уокер. – М. : Вильямс, 2003. – 208 с. : ил.



Авторы книги детально рассматривают новую, комплексную, модель риск-менеджмента на предприятии. Она характеризуется тем, что управление рисками перестает быть заботой отдельных специалистов (производственников, финансистов, маркетологов и т. д.), а выходит на новый, стратегический уровень. В основе книги лежит практика риск-менеджмента пяти ведущих американских компаний (United Grain Growers (сельское хозяйство), DuPont (химическая промышленность), Unocal (энергетика), Chase Manhattan (финансы), Microsoft (высокие технологии). Богатейший фактический материал позволил авторам подробно проанализировать процесс риск-менеджмента, рассмотреть новые факторы риска и практические инструменты риск-менеджмента (сценарный анализ; подход EAR; кривая прибыли/убытки и др.), показать место и функции финансового руководителя в процессе риск-менеджмента.

Книга будет полезна специалистам по риск-менеджменту, руководителям компаний.

У01

Р54 Риск-менеджмент : учебник [для студ. экон. спец. вузов] /

В. Н. Вяткин, И. В. Вяткин, В. А. Гамза и др. ; под ред.

И. Юргенса. – М. : ИТК "Дашков и К", 2003. – 493 с. : ил.



Настоящее издание является вводным учебником для всех, кто занимается вопросами управления риском. Все разделы учебника написаны с позиции генерального риск-менеджера фирмы, в нем приводится основная терминология риск-менеджмента, история его зарождения и развития, а также раскрывается система интегрированного управления риском. Рассматриваются аспекты риска как явления природы, виды рисков, инструментарий воздействия на риски и фундаментальное соотношение риска и доходности.

Последние две главы учебника посвящены основам человеческого поведения в рискованной обстановке и профессии риск-менеджера. Эта книга должна стать началом профессиональной сертификации риск-менеджеров.

Для студентов экономических вузов, преподавателей, аспирантов, а также специалистов в области управления рисками.

У01

У84 Уткин Э. А.

Управление рисками предприятиями : учеб.-практ. пособие /
Э. А. Уткин, Д. А. Фролов. – М. : ТЕИС, 2003. – 248 с. : ил.

Э.А. УТКИН, Д.А. ФРОЛОВ

УПРАВЛЕНИЕ
РИСКАМИ
ПРЕДПРИЯТИЯ

Учебно-практическое пособие

Бизнес всегда связан с неопределенностью, риском, усиливающейся конкуренцией, множеством внешних угроз и опасностей. Тем не менее, риск является неотъемлемой частью деловой активности на любом рынке. Чем дело рискованнее, тем больше шансов на повышенную прибыль, но в случае неудачи возрастают, соответственно, и потери. В России бизнес сегодня носит особенно рискованный характер. Нестабильная экономика, еще недостаточно разработанная правовая база предпринимательства, практическое отсутствие этических его основ, влияние мощного теневого сектора хозяйства, агрессивные действия мафиозных структур серьезно мешают прогрессу предпринимательства. Тем не менее, и в столь сложных обстоятельствах многие отечественные предприятия успешно развиваются в основном за счет эффективного использования огромного потенциала современного риск-менеджмента.

В предлагаемом учебно-практическом пособии раскрывается специфика механизма управления рисками предприятия, применительно к российской действительности, характеризуются пути, формы и методы устранения потенциальных потерь. Книга рассчитана на руководителей, менеджеров предприятий, специалистов по управлению, бизнесменов, начинающих предпринимателей, научных работников. Она предназначена также для преподавателей, аспирантов и студентов экономических вузов и факультетов, слушателей школ бизнеса.

Раздел «Управление рисками в банковском бизнесе» подготовлен к.э.н. Б. З. Гвоздевым, в работе использована также часть материалов по интегральному риску, предоставленная к.э.н. А. Н. Мырынюком. Главы I, II, III, V написаны Д. А. Фроловым.

У5

Ч-48 Черкасов В. В.

Проблемы риска в управленческой деятельности /
В. В. Черкасов. – 2-е изд., перераб. и доп. – М. : Рефл-бук ; К. :
Ваклер, 2002. – 320 с. : ил.



В книге раскрывается содержание и особенности управленческой деятельности в условиях риска, обусловленного рыночной экономикой. Рассматривается сущность риска как управленческой категории, предлагается функциональный подход к классификации риска и информационно-стратегическому обеспечению управленческой деятельности. Раскрываются принципиально новые подходы к снижению управленческого риска на основе комплексного анализа и экономической оценки степени управленческого риска. Рекомендуется научным работникам, профессорско-преподавательскому составу, менеджерам, предпринимателям, бизнесменам, руководителям, специалистам.

У01

У67 **Управление риском в рыночной экономике / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ю. Ю. Екатеринославский, Дж. Дж. Хэмптон. – М. : Экономика, 2002. – 197 с. : ил.**



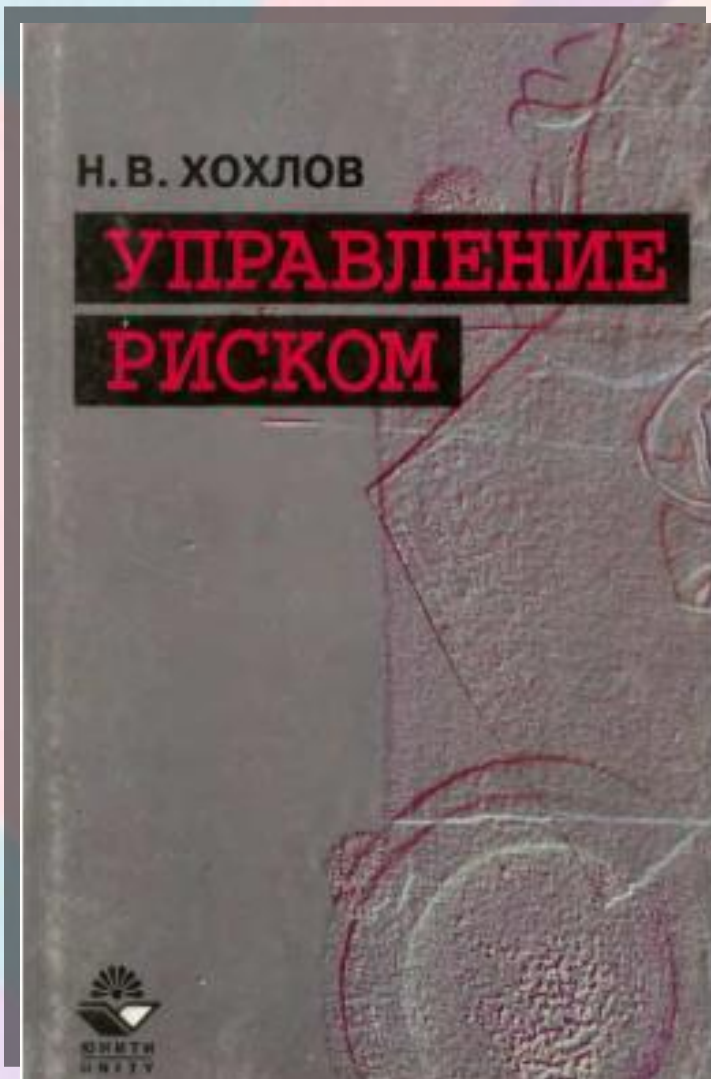
В книге последовательно излагаются основы новой для российского бизнеса дисциплины - управления рисками фирмы, ведущей свой бизнес в условиях рыночной экономики. В краткой форме рассматриваются все основные компоненты риск-менеджмента: от определения основных терминов и философии риска через диагностику, анализ и картографирование рисков к методике обустройства службы управления рисками на фирме. Книга написана при поддержке североамериканского Общества управления риском и страхованием, чья всемирно признанная учебно-сертификационная программа подготовки риск-менеджеров представлена во второй части книги.

Книга предназначена для широкого круга читателей, связанных с предпринимательством, руководителей фирм, риск-менеджеров и студентов, изучающих бизнес.

У01

Х86 Хохлов Н. В.

Управление риском : учеб. пособие для студ. вузов /
Н. В. Хохлов. – М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2001. – 239 с. : ил.



Базовый профессиональный курс по риск-менеджменту охватывает комплекс проблем в соответствии с международными стандартами преподавания этой дисциплины: финансирование риска, интегральная оценка риска, экономическая эффективность различных методов риск-менеджмента, оценка и управление инвестиционными рисками.

Приведены практические примеры и рекомендации по организации риск-менеджмента на предприятии.

Для студентов экономических специальностей вузов, менеджеров предприятий, специалистов страховых и кредитных организаций.

У01

М48 Мельников А. В.

Риск-менеджмент : стохастический анализ рисков в экономике финансов и страхования : [учеб. пособие] / А. В. Мельников. – М. : Анкил, 2001. – 112 с. : ил. + прил.



Данная книга посвящена упрощенному изложению комплекса идей, фактов и методов финансовой и актуарной математики, составляющего основу количественного риск-менеджмента в современных финансах и страховании. В ней приводится методология расчетов и управления рисками, возникающими в финансах и страховании в связи с «оттянутыми в будущее» платежными обязательствами, даются сведения о моделях рисков, принципах и методах расчетов премий в страховании жизни, имущественном страховании и перестраховании. Вместе с традиционным материалом книга содержит много нового материала, отражающего инновационный тренд в актуарной науке и экономике страхования под влиянием современной математики финансов.

Книга, как учебное пособие, может составить основу соответствующих курсов лекций по управлению риском, актуарной и финансовой математике для университетских специальностей экономико-математического направления.

У01

Р59 Рогов М. А.

Риск-менеджмент : [монография] / М. А. Рогов. – М. : Финансы и статистика, 2001. – 120 с. : ил.



Монография посвящена управлению рыночными рисками и охватывает материал программы GARP по квалификации Financial Risk Manager с учетом современной российской практики и теории. Построенный на основе данной программы авторский курс был апробирован в РЭА им. Г.В. Плеханова в Москве. В числе слушателей – представители JP Morgan, Внешторгбанка, Сбербанка, Банка Москвы, ИК "Тройка Диалог" и др.

Для предпринимателей, финансовых аналитиков, риск-менеджеров, трейдеров, экономистов, служб внутреннего контроля банков и финансовых организаций, а также студентов, бакалавров, магистров, аспирантов и докторантов экономических специальностей высших учебных заведений.

**Только об одном можно жалеть в жизни -
о том, что ты когда-то так и не рискнул.**

Рискуйте чаще, смелые поступки

иногда меняют жизнь...

Посети библиотеку - познай мир!!!

Уважаемые читатели!

Научная библиотека ДонГТУ ждёт вас.



Наш адрес: г. Алчевск, ул. Ленинградская, 45а,
Научная библиотека ДонГТУ,
сектор экономической литературы (306 ауд.)

<http://library.dstu.education>