

№ 2733

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ «МИСИС»

Кафедра промышленного менеджмента

И.А. Ларионова

Риск-менеджмент

Учебное пособие

Рекомендовано редакционно-издательским
советом университета



Москва 2017

УДК 65.01 (075.8)
Л25

Рецензент
канд. экон. наук, доц. *Е.Н. Елисеева*

Ларионова И.А.

Л25 Риск-менеджмент : учеб. пособие / И.А. Ларионова. – М. :
Изд. Дом МИСиС, 2017. – 31 с.
ISBN 978-5-906846-47-1

Рассматриваются методы расчета показателей, оценивающих уровень риска в различных экономических условиях, а также методы оптимизации уровня риска.

Пособие может быть использовано магистрантами, обучающимися по программам «Производственный менеджмент», «Финансовый менеджмент», «Управление бизнесом» направления 38.04.02 «Менеджмент».

УДК 65.01 (075.8)

ISBN 978-5-906846-47-1

© И.А. Ларионова, 2017
© НИТУ «МИСиС», 2017

ОГЛАВЛЕНИЕ

| | |
|---|----|
| Введение | 4 |
| 1. Концентрация рисков в бизнесе | 5 |
| 1.1. Основные определения | 5 |
| 1.2. Классификация рисков | 6 |
| 1.3. Организация процесса риск-менеджмента | 9 |
| 2. Статистические методы оценки рисков | 11 |
| 2.1. Основные статистические показатели оценки рисков | 11 |
| 2.2. Рисксовая стоимость | 14 |
| 2.3. Методы вычисления рисксовой стоимости | 15 |
| 2.4. Пример расчета рисксовой стоимости ковариационным методом | 17 |
| 3. Методы оценки рисков вложений в ценные бумаги | 21 |
| 3.1. Рыночная модель | 21 |
| 3.2. Общий риск ценной бумаги | 22 |
| 3.3. Общий риск портфеля ценных бумаг | 24 |
| 3.4. Выбор оптимального портфеля ценных бумаг | 25 |
| Библиографический список | 31 |