

На сайте информационного-аналитического портала "НБРА-IBRA" (www.ibra.com.ua) представлена лучшая коллекция рефератов, дипломных, курсовых и контрольных работ, лекций и электронных книг и учебников для студентов специальностей: банковское дело, финансы, экономика, менеджмент, учет и аудит.

21.07.2010г. в раздел ["Семинары и обучение"](#) (категория "Книги по ценным бумагам") представлена для ознакомления новая книга сайта!

Издательско-торговая корпорация «Дашков и К»

«1 д
ца

А. С. ШАПКИН

ЭКОНОМИЧЕСКИЕ И ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

**ОЦЕНКА, УПРАВЛЕНИЕ,
ПОРТФЕЛЬ ИНВЕСТИЦИЙ**

Москва
2003

Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций

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.