

АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

Научная библиотека

БНТУ



* 8 0 1 2 3 2 9 3 6 *

В. В. Арсенов

**УПРАВЛЕНИЕ
ЭКОНОМИЧЕСКИМИ РИСКАМИ**

*Допущено Министерством образования Республики Беларусь
в качестве учебного пособия для слушателей
системы дополнительного образования взрослых
по специальностям переподготовки
«Антикризисное управление предприятием»,
«Экономика и управление на предприятии промышленности»,
«Деловое администрирование»*

НАВУКОВАЯ БІБЛІЯТЭКА

Беларускага нацыянальнага
тэхнічнага ўніверсітэта

Інв. № **1882674**

Минск
2021

ОГЛАВЛЕНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	3
ГЛАВА 1	
Риск как экономическая категория, его сущность	6
1.1. Экономические угрозы национальной безопасности.....	6
1.2. Экономические риски и неопределенность	10
1.3. Современные концепции риска	16
Вопросы для самоконтроля.....	20
ГЛАВА 2	
Виды рисков	21
2.1. Общие принципы классификации экономических рисков	21
2.2. Классификация рисков коммерческих организаций.....	23
2.3. Виды экономических рисков в зависимости от возможного экономического результата.....	28
2.4. Виды страховых рисков.....	29
2.5. Классификация экономических рисков по различным факторам их возникновения и характеру последствий.....	30
2.6. Классификация по степени допустимости экономических рисков.....	34
Вопросы для самоконтроля.....	36
ГЛАВА 3	
Методы анализа и оценки рисков	37
3.1. Общеметодологические подходы анализа риска организаций	37
3.2. Методы качественной оценки показателей риска	39
3.2. Количественные методы оценки показателей риска	46
3.3. Аналитические методы	51
3.4. Последовательность анализа и оценки экономического риска.....	56
3.5. Метод картографирования рисков.....	59
3.6. Классификация видов, источников и методов получения информации об экономических рисках	62
Вопросы для самоконтроля.....	67

ГЛАВА 4

Хозяйственные и имущественные риски	68
4.1. Основные методы управления экономическими рисками	68
4.2. Методы снижения экономических рисков	70
4.3. Инновационные риски	80
Вопросы для самоконтроля	82

ГЛАВА 5

Финансовые риски и политика управления ими	84
5.1. Категории финансовых рисков	84
5.2. Кредитные риски	93
5.3. Инвестиционные риски	96
5.4. Валютные риски	100
5.5. Налоговые риски	104
5.6. Отдел рискованных вложений капитала: цели и функции	107
Вопросы для самоконтроля	108

ГЛАВА 6

Способы нейтрализации финансовых рисков	110
6.1. Способы снижения степени финансовых рисков	110
6.2. Хеджирование	116
6.3. Методы управления кредитными рисками	122
6.4. Система управления налоговыми рисками в организации ...	126
6.5. Рациональный выбор инвестиционного портфеля	128
6.6. Способы выбора решения рискованного вложения капитала ...	135
6.7. Методика анализа рисков на базе бухгалтерской отчетности организации	141
Вопросы для самоконтроля	144

ГЛАВА 7

Информационные технологии в управлении рисками	145
7.1. Основные программные продукты, используемые в управлении рисками	145
7.2. Компьютерное имитационное моделирование	147
7.3. Технологии ситуационного моделирования экономической деятельности	151
7.4. Перспективы использования методов и технологий цифровой экономики	154

7.5. Управление информационными рисками	157
Вопросы для самоконтроля.....	163

ГЛАВА 8

Банкротство как финансовый риск	164
8.1. Неплатежеспособность – свидетельство риска банкротства.....	164
8.2. Факторы, влияющие на разработку управленческих решений антикризисного управления организацией	169
8.3. Управление рисками при проведении процедуры экономической несостоятельности (банкротстве).....	171
8.4. Оценка вероятности банкротства организаций.....	174
8.5. Основные риски, связанные с проведением реструктуризации	176
8.6. Обоснованный экономический риск.....	178
Вопросы для самоконтроля.....	180

ГЛАВА 9

Организация управления экономическими рисками.....	181
9.1. Организация работ по оценке и анализу рисков	181
9.2. Стратегия риск-защищенности организации	184
9.3. Организационная структура системы управления рисками (СУР) организации	187
9.4. Создание и развитие риск-ориентированной культуры организации	189
Вопросы для самоконтроля.....	192

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ	193
---	------------