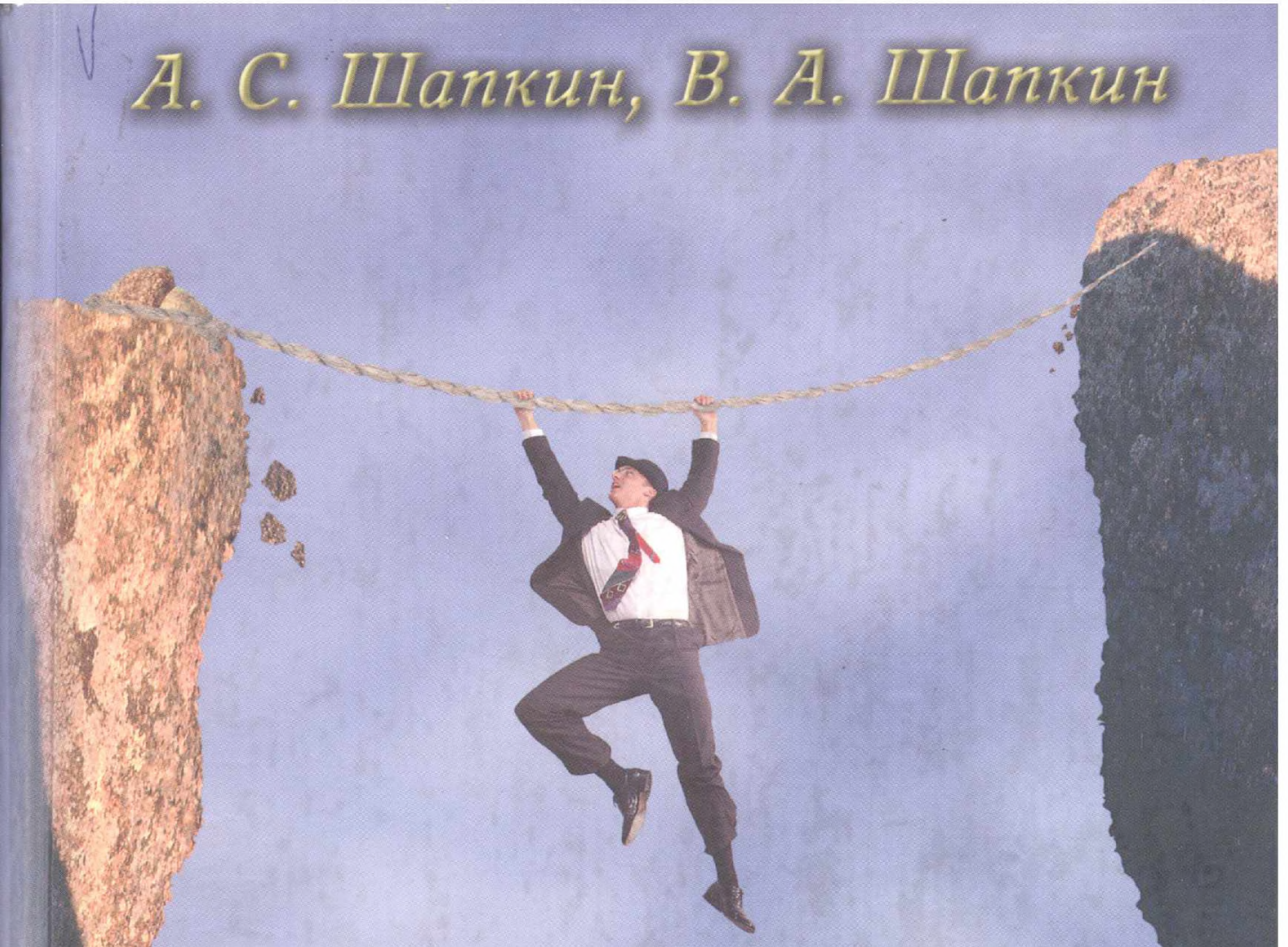
А. С. Шапкин, В. А. Шапкин



ТЕОРИЯ РИСКА И МОДЕЛИРОВАНИЕ РИСКОВЫХ СИТУАЦИЙ

Учебник

«Дашков и К°»
Издательско-торговая корпорация

Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°»

А. С. ШАПКИН, В. А. ШАПКИН

Теория риска и моделирование рисковых ситуаций

Учебник

Допущено
Министерством образования и науки
Российской Федерации в качестве учебника
для студентов высших учебных заведений,
обучающихся по специальности
«Математические методы в экономике»

Москва 2006

330.1(9)
330.341
+330.115

УДК 330.13.7:338.24:330.4(075.8)
ББК 65.9(2)-210.3
Ш23

КОЛЛЕКТИВ АВТОРОВ:

д.э.н. **Шапкин А. С.** (гл. 4, 5, 6, 7, 10)
к.э.н. **Шапкин В. А.** (гл. 1, 2, 3, 8, 9, 11)

РЕЦЕНЗЕНТЫ:

кафедра экономики и менеджмента
МИПК Российской экономической академии им. Г. В. Плеханова
(зав. кафедрой доктор экономических наук,
профессор **Л. М. Бадалов**);
доктор экономических наук, профессор **Б. А. Лагоша**

Ш23 **Шапкин А. С., Шапкин В. А. Теория риска и моделирование рисковых ситуаций:** Учебник. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2006. – 880 с.

ISBN 5-94798-488-1

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 рисковых 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 биснес-школ, риск-менеджеров, менеджеров инноваций, инвестиций, а также специалистов банковских и финансовых структур, работников пенсионных, страховых и инвестиционных фондов.

826514
TDIU
kutubxonasi

© А. С. Шапкин, В.А. Шапкин, 2006