

Энциклопедия финансового риск-менеджмента



| | |
|--------------------------|------------------|
| Author: | Виктор Барбаумов |
| Goodreads Rating: | 5.00 |
| Pages: | 936 |
| Genre: | Uncategorized |
| Language | Russian |
| Published: | 2009 |

[Энциклопедия финансового риск-менеджмента.pdf](#)

[Энциклопедия финансового риск-менеджмента.epub](#)

Эта книга - первое в России издание учебно-энциклопедического характера, в котором в соответствии с международными стандартами освещаются основные вопросы финансового риск-менеджмента. Издание дополнено новыми материалами по организационным аспектам риск-менеджмента, моделям эволюции процентных ставок, рискам страхования банковских вкладов и анализу макроэкономических рисков. Рассмотрены современные методы количественной оценки и управления финансовыми рисками, теория экстремальных значений, соглашения о форвардной процентной ставке и др. Дан систематизированный обзор методов количественного анализа, используемых в риск-менеджменте, моделей ценообразования и стратегий применения производных финансовых инструментов. Приведен обзор основных положений Нового базельского соглашения по капиталу 2004 г., выполненных на основе последней редакции соглашения от ноября 2006 г. Книга предназначена для профессионалов, непосредственно занимающихся оценкой и управлением рисками, преподавателей, студентов и аспирантов экономических факультетов вузов.

Она также может использоваться для подготовки к сдаче международных экзаменов по финансовому риск-менеджменту на получение сертификатов Financial Risk Manager и Professional Risk Manager.