

ЛИМИТИРОВАНИЕ КОНЦЕНТРАЦИИ РИСКА

ЧАСТЬ III

ЛИМИТИРОВАНИЕ

ЧАСТЬ II

КОНЦЕНТРАЦИИ

ЧАСТЬ I

РИСКА

ЧАСТЬ I: РИСК

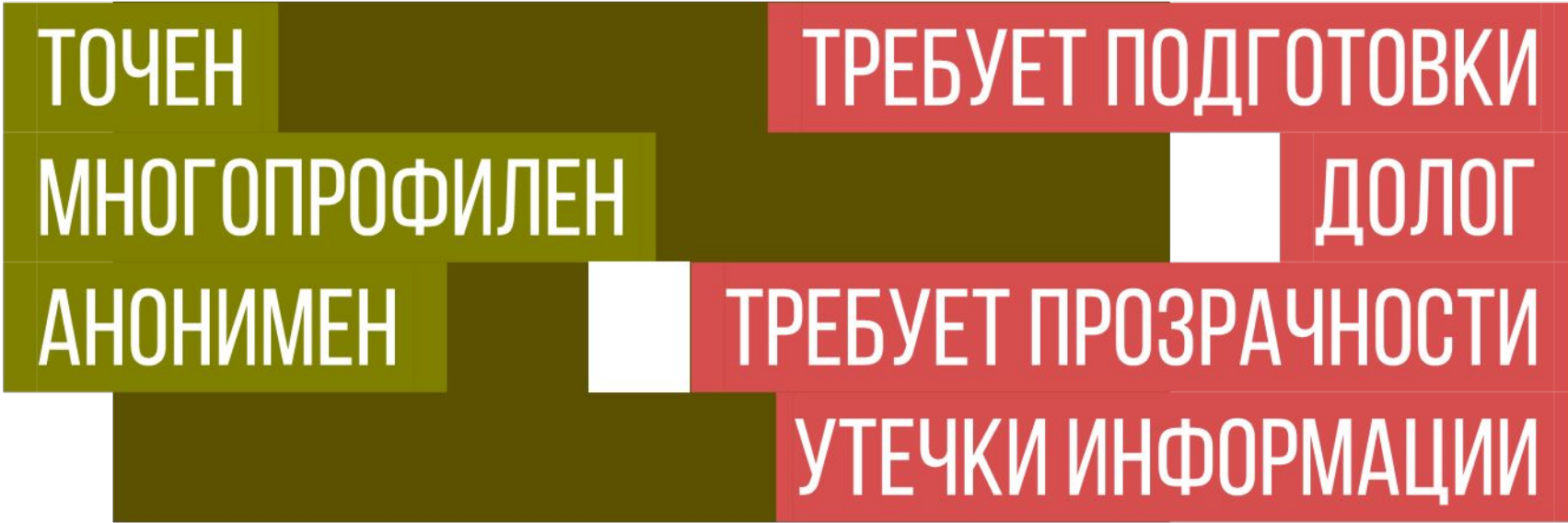
**ВЕРОЯТНОСТЬ ПОТЕРИ ЧЕГО-ЛИБО
ПРИ ПЛОХОМ СТЕЧЕНИИ ОБСТОЯТЕЛЬСТВ**

НЕБЛАГОПРИЯТНЫЕ ИСХОДЫ

ВСЕ ВОЗМОЖНЫЕ ИСХОДЫ

МЕТОД ДЕЛЬФИ ОСНОВАН НА МНЕНИИ
ЭКСПЕРТОВ, ПРИГЛАШЕННЫХ ДЛЯ УЧАСТИЯ
В ПРОЦЕССЕ ИДЕНТИФИКАЦИИ РИСКОВ

ОЦЕНКА РИСКОВ МЕТОД ДЕЛЬФИ



**VAR - ЭТО РАСЧЁТ СУММАРНОГО УБЫТКА,
КОТОРЫЙ НЕ ПРЕВЫШАЕТ ПОТЕРЮ СТОИМОСТИ
ПОРТФЕЛЯ ЗА ЛЮБОЙ ПРОМЕЖУТОК ВРЕМЕНИ
И УЧИТЫВАЕТ ТЕКУЩИЕ ВЕРОЯТНОСТИ**

ОЦЕНКА РИСКОВ

МЕТОД VAR

АБСОЛЮТНО ТОЧЕН

ОГРАНИЧЕН ВО ВРЕМЕНИ

ТАРГЕТИРОВАН

ИНВЕСТО-ОРИЕНТИРОВАН

ЭКОНОМИЧЕН

ТРУДНОСТИ В РАСЧЁТЕ

ВАРИАТИВЕН

ТРЕБУЕТ МНОГОКРАТНОСТИ

ОЦЕНКА РИСКА НА ПРЕДПРИЯТИИ
ОХВАТЫВАЕТ СЛЕДУЮЩИЕ ОБЛАСТИ

МЕДИЦИНСКИЕ

ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ

НЕКОММЕРЧЕСКИЕ

ФИНАНСОВЫЕ

ОЦЕНКА РИСКА НА ПРЕДПРИЯТИИ
ОХВАТЫВАЕТ СЛЕДУЮЩИЕ ОБЛАСТИ

МЕДИЦИНСКИЕ
ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ
НЕКОММЕРЧЕСКИЕ
ФИНАНСОВЫЕ

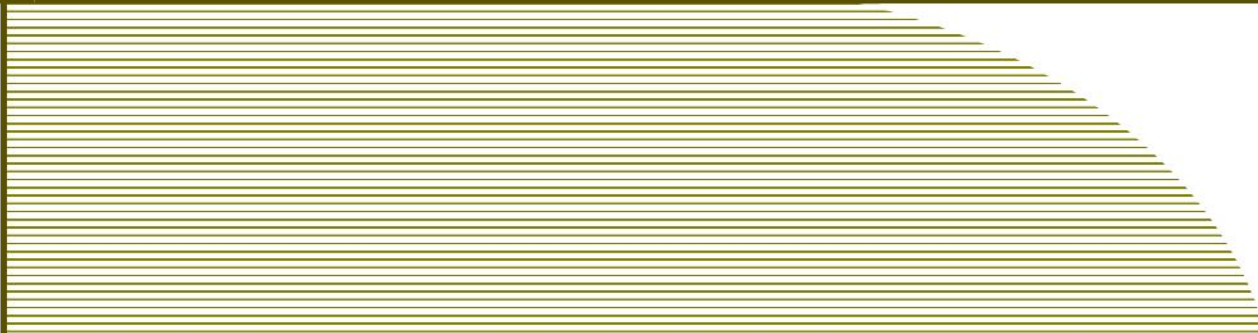
**РИСКИ, СВЯЗАННЫЕ С ВЕРОЯТНОСТЬЮ
ВОЗНИКНОВЕНИЯ СИТУАЦИИ БАНКРОТСТВА**

ЧАСТЬ II: КОНЦЕНТРАЦИЯ

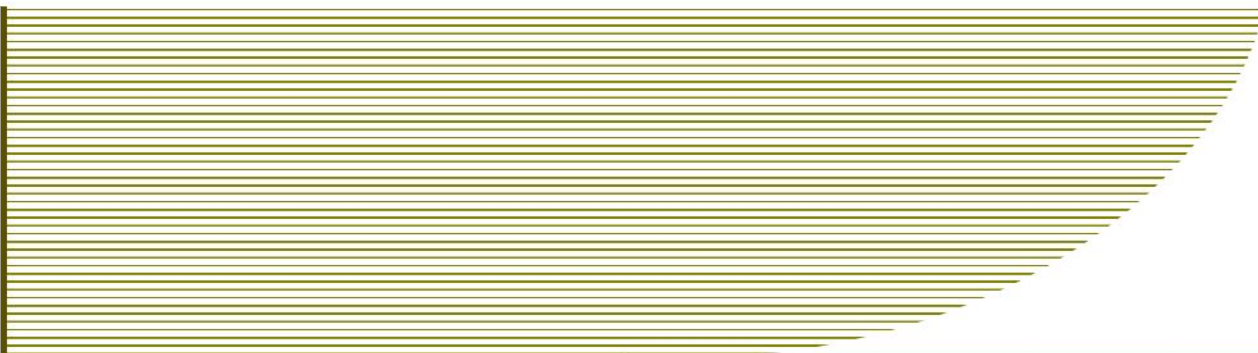
**НАКОПЛЕНИЕ ЧЕГО-ЛИБО
В ЗАКРЫТОЙ СИСТЕМЕ**

**НАКОПЛЕНИЕ НЕ ВСЕГДА
ЯВЛЯЕТСЯ НЕГАТИВНЫМ ЯВЛЕНИЕМ**

ПОТОЛОК НАКОПЛЕНИЯ



ПОЛ НАКОПЛЕНИЯ



ЧАСТЬ III: ЛИМИТИРОВАНИЕ

**УСТАНОВЛЕНИЕ ПРЕДЕЛЬНО ДОПУСТИМОГО
ЗНАЧЕНИЯ ЧЕГО-ЛИБО**

ПРЕДЕЛЬНЫЙ РАЗМЕР (УДЕЛЬНЫЙ ВЕС) ЗАЁМНЫХ СРЕДСТВ

ЛИМИТ НА

ПРЕДЕЛЬНЫЙ РАЗМЕР (УДЕЛЬНЫЙ ВЕС) ЗАЁМНЫХ СРЕДСТВ

УСТАНАВЛИВАЕТСЯ РАЗДЕЛЬНО ДЛЯ
ОПЕРАЦИОННОЙ И ИНВЕСТИЦИОННОЙ
ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПРЕДПРИЯТИЯ

ЛИМИТ НА

ПРЕДЕЛЬНЫЙ РАЗМЕР (УДЕЛЬНЫЙ ВЕС) ЗАЁМНЫХ СРЕДСТВ

ФИНАНСИРОВАНИЕ РЕАЛЬНОГО
ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОЕКТА

ФИНАНСИРОВАНИЕ ФОРМИРОВАНИЯ
ОБОРОТНЫХ АКТИВОВ

ЛИМИТ НА

МИНИМАЛЬНЫЙ РАЗМЕР (УДЕЛЬНЫЙ ВЕС) АКТИВОВ

ФОРМИРОВАНИЕ «ЛИКВИДНОЙ ПОДУШКИ»,
ХАРАКТЕРИЗУЮЩЕЙ РАЗМЕР
РЕЗЕРВИРОВАНИЯ ВЫСОКОЛИКВИДНЫХ
АКТИВОВ С ЦЕЛЬЮ ПРЕДСТОЯЩЕГО
ПОГАШЕНИЯ НЕОТЛОЖНЫХ ФИНАНСОВЫХ
ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПРЕДПРИЯТИЯ

ЛИМИТ НА

МАКСИМАЛЬНЫЙ РАЗМЕР ДЕПОЗИТНОГО ВКЛАДА,
РАЗМЕЩАЕМОГО В ОДНОМ БАНКЕ ИЛИ ВЛОЖЕНИЯ
СРЕДСТВ В ЦЕННЫЕ БУМАГИ ОДНОГО ЭМИТЕНТА ИЛИ НА
КОЛИЧЕСТВО БАНКОВ, В КОТОРЫЕ ВЛОЖЕНЫ СРЕДСТВА

НАПРАВЛЕНА НА СНИЖЕНИЕ КОНЦЕНТРАЦИИ
РИСКА ПРИ ФОРМИРОВАНИИ ПОРТФЕЛЯ
ЦЕННЫХ БУМАГ

ЧАСТЬ III

ЛИМИТИРОВАНИЕ

ЧАСТЬ II

КОНЦЕНТРАЦИИ

ЧАСТЬ I

РИСКА

ЛИМИТИРОВАНИЕ КОНЦЕНТРАЦИИ РИСКА