

КОНЦЕПЦИЯ РИСКА КАК РЕСУРСА И ЕЕ ПРИМЕНЕНИЕ К ПОРТФЕЛЬНЫМ ИНВЕСТИЦИЯМ

Секерин А. Б.

Рассматривается задача управления риском на основе концепции “Риск как ресурс”. Введено понятие ресурсно-подобного проявления риска и охарактеризован механизм такого проявления. Управление риском как ресурсом заключается в достижении его оптимального уровня. Доказана общая теорема, следствием которой является наличие единственного оптимального уровня риска портфеля ценных бумаг.