

Аннотация

Финансовый риск-менеджмент

Цель дисциплины:

Формирование у студентов научного мировоззрения в сфере экономических особенностей финансового риск – менеджмента в современных условиях и формирование навыков работы в финансовых и кредитных институтах, корпорациях и органах государственной власти.

Краткое содержание:

Сущность и классификация рисков Основы теории предпринимательских рисков. Содержание концепции корпоративных финансов «риск-доходность». Влияние финансовых рисков на стоимость компании. Методы оценки финансовых рисков и неопределенности Количественная оценка финансового риска. Подходы к измерению степени финансового риска – априори и апостериори. Показатели оценки финансового риска. Содержание и анализ финансовых рисков Понятие риска утраты ликвидности (платежеспособности). Инструментарий оценки и анализа риска утраты ликвидности и платежеспособности. Управление финансовыми рисками. Цель, содержание и задачи корпоративного риск-менеджмента (EnterpriseWide Risk Management, ERM). Стандарты управления рисками.