

Аннотация дисциплины «Основы финансового риск-менеджмента»
для бакалавров, обучающихся по направлению 38.03.02 «Менеджмент» профиль
«Финансовый менеджмент»

Цель дисциплины

Формирование теоретических знаний об основах финансового риск-менеджмента, современных подходах к управлению финансовыми рисками.

Место дисциплины в структуре ООП :

Дисциплина «Основы финансового риск-менеджмента» является дисциплиной профиля «Финансовый менеджмент» учебного плана подготовки бакалавров по направлению 38.03.02 «Менеджмент».

Краткое содержание

Современное понимание роли риск-менеджмента. Поведение рынка. Количественные методы: актуализация. Вероятностно-статистическое описание неопределенности в финансовых моделях. Отношение к риску и управление портфелем. Производные финансовые инструменты. Оценка и управление рыночным риском. Оценка и управление процентным риском. Оценка и управление кредитным риском. Операционные риски. Особенности риск-менеджмента в нефинансовых компаниях. Управление риском ликвидности фондирования.