

Аннотация дисциплины

«ОСНОВЫ ФИНАНСОВОГО РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА»

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 модуля профиля направления 38.03.02 «Менеджмент», профиль «Финансовый 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.