

Аннотация дисциплины

«Основы финансового риск-менеджмента»

Цель дисциплины: формирование теоретических знаний об основах финансового риск-менеджмента, современных подходах к управлению финансовыми рисками.

Формирование следующей компетенции:

ПКП-3: Способность осуществлять анализ и прогнозирование финансового состояния, результатов деятельности и денежных потоков организации в условиях риска и неопределенности

Место дисциплины в структуре ОП:

Дисциплина «Основы финансового риск-менеджмента» является дисциплиной по выбору вариативной части профессионального цикла дисциплин основной образовательной программы (ООП) по направлению 38.03.02 «Менеджмент», профиль «Финансовый менеджмент (бакалавриат)». Изучение дисциплины «Управление организацией в условиях кризиса» базируется на сумме знаний, полученных студентами в процессе изучения базовых дисциплин профессионального цикла: «Эконометрика», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Основы финансовых вычислений», «Финансовые рынки и институты», «Финансы, деньги, кредит», «Бухгалтерская (финансовая) отчетность».

Краткое содержание

Содержание и классификация рисков. Методы оценки уровня финансовых рисков. Качественные методы оценки финансовых рисков: экспертный, комиссии, суда, Дельфи. Количественные методы оценки финансовых рисков: финансовых коэффициентов, сравнительный, сценарный, анализа чувствительности, Монте-Карло, САРМ, дерева решений. Методы управления финансовыми рисками. Активное и пассивное управление финансовыми рисками. Методы, снижающие вероятность проявления рисков. Методы, снижающие последствия ущерба от реализации риска. Основные положения организации финансового риск-менеджмента. Принципы и функции финансового риск-менеджмента. Ключевые направления рискованного вложения капитала крупнейших российских компаний. Особенности организации финансового риск-менеджмента в банках. Особенности организации финансового риск-менеджмента в венчурных компаниях (фондах).