

Аннотация дисциплины
«Финансовые риски портфельных инвестиций»

Цель дисциплины: формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков оценки и управления финансовыми рисками при формировании инвестиционного портфеля организации (предприятия) в современных рыночных условиях.

Место дисциплины в структуре ОП:

Дисциплина «Финансовые риски портфельных инвестиций» является дисциплиной по выбору студента вариативной части профессионального цикла образовательной программы бакалавриата, по направлению 38.03.02 «Менеджмент» профиль «Финансовый менеджмент», «Инвестиционный менеджмент».

Для освоения дисциплины «Финансовые риски портфельных инвестиций» студент должен обладать знаниями, полученными при изучении предшествующих дисциплин: «Финансовый менеджмент», «Инвестиционная стратегия», «Основы финансовых вычислений» и др.

Краткое содержание дисциплины:

Методологические и информационные основы управления финансовыми рисками; формирование портфеля и портфельный анализ; содержание процесса управления финансовыми рисками портфельных инвестиций; способы измерения финансовых рисков портфельных инвестиций; анализ рисков портфеля акций и облигаций; производные финансовые инструменты и их применение для управления финансовыми рисками.