

Аннотация дисциплины
ФИНАНСОВЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Цель дисциплины:

Формирование теоретических знаний об основах финансового риск-менеджмента, современных подходах к управлению финансовых рисков.

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.