

УДК 658.152
ББК 65.291.9
С29

Издание доступно в электронном виде по адресу
<https://bmstu.press/catalog/item/6942/>

Факультет «Инженерный бизнес и менеджмент»
Кафедра «Финансы»

*Рекомендовано Научно-методическим советом МГТУ им. Н.Э. Баумана
в качестве учебно-методического пособия*

Селюков, В. К.

С29 Управление финансовыми рисками. Курсовое проектирование: учебно-методическое пособие / В. К. Селюков. — Москва : Издательство МГТУ им. Н. Э. Баумана, 2020. — 58, [2] с. : ил.

ISBN 978-5-7038-5393-1

Представлено задание на выполнение курсовой работы «Разработка технологии управления финансовыми рисками организации» по дисциплине «Управление финансовыми рисками». Приведены рекомендации по выполнению и примеры реализации отдельных этапов, а также рекомендации по оформлению расчетно-пояснительной записки и презентации курсового проекта.

Для студентов бакалавриата по направлению подготовки «Инноватика».

УДК 658.152
ББК 65.291.9



Уважаемые читатели! Пожелания, предложения, а также сообщения о замеченных опечатках и неточностях Издательство просит направлять по электронной почте: info@baumanpress.ru

ISBN 978-5-7038-5393-1

© МГТУ им. Н.Э. Баумана, 2020
© Оформление. Издательство
МГТУ им. Н.Э. Баумана, 2020

Оглавление

Предисловие	3
1. Задание на выполнение курсовой работы	5
1.1. Тема курсовой работы и целевые установки	5
1.2. Содержание курсовой работы	5
1.3. Порядок выполнения курсовой работы	6
1.4. Рекомендации по планированию выполнения этапов курсовой работы	7
1.5. Содержание и оформление расчетно-пояснительной записки	8
1.6. Контроль за ходом выполнения курсовой работы	9
Вопросы для самоконтроля и защиты курсовой работы	10
2. Рекомендации по выполнению курсовой работы и примеры реализации отдельных ее этапов	12
2.1. Выявление уязвимостей в деятельности организации	12
2.1.1. Основные виды анализа, применяемые в процессе выявления уязвимостей в деятельности организации	12
2.1.2. Анализ влияния внешних факторов на деятельность организации	13
2.1.3. Анализ финансово-экономической и операционной деятельности организации	18
2.1.4. Составление перечня уязвимостей в деятельности компании	31
2.2. Оценка рисков. Выявление доминирующего финансового риска	34
2.2.1. Идентификация рисков организации	34
2.2.2. Качественный анализ рисков организации. Выявление доминирующего финансового риска	36
2.2.3. Измерение доминирующего финансового риска организации	41
2.3. Разработка метода управления доминирующим финансо- вым риском организации	46
2.3.1. Сравнительный анализ существующих методов управления доминирующим финансовым риском. Выбор метода управления риском	46
2.3.2. Расчет фьючерсной позиции для компании «С»	50
2.4. Оценка эффективности принятого решения	54
Литература	56
Приложение 1	57
Приложение 2	58