

Tóm tắt Đề tài: các phương pháp định lượng trong quản lý rủi ro tài chính và một số ứng dụng cho các doanh nghiệp Việt Nam (QK.04.05)

Mã số: QK.04.05

Thời gian thực hiện: 9/2004 - 9/2006

Đơn vị chủ trì: Trường Đại học Kinh tế - ĐHQGHN

Chủ nhiệm đề tài: ThS. Nguyễn Thế Hùng

Tham gia thực hiện: ThS. Đỗ Thanh Hà, ThS. Hoàng Thanh Mai

Tóm tắt mục tiêu, nội dung và kết quả nghiên cứu:

Kết quả chính của đề tài:

- Tìm hiểu và khai thác các phương pháp định lượng hiện đại trong quản lý rủi ro tài chính tại các doanh nghiệp (Tổ chức tài chính, tín dụng, ngân hàng). Nhấn mạnh đến một số công cụ quan trọng như VAR, công thức định giá quyền chọn Black -Scholes
- Thông qua các tình huống về quản lý rủi ro tại các tổ chức tài chính ngân hàng nước ngoài rút ra bài học kinh nghiệm cho các doanh nghiệp Việt Nam.
- Nhận thức được tầm quan trọng của việc xây dựng hệ thống quản lý rủi ro tài chính tại các doanh nghiệp Việt Nam (Dùng mô hình và các công cụ định lượng).

Khả năng ứng dụng:

- Làm tài liệu giảng dạy, tham khảo cho sinh viên ngành Tài chính Ngân hàng.
- Kết hợp với các tổ chức tài chính ngân hàng khai thác, ứng dụng các công cụ định lượng trong quản lý rủi ro hoạt động tài chính, kinh doanh.
- Có thể kết hợp với sinh viên hoặc các nhà nghiên cứu khác tiếp tục nghiên cứu sâu hơn về quản lý rủi ro tài chính.