

АННОТАЦИЯ УЧЕБНЫХ ДИСЦИПЛИН МАГИСТЕРСКОЙ ПРОГРАММЫ «ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ИНСТИТУТЫ»

«Управление активами и пассивами(ALM) коммерческого банка»

ФИО преподавателя: Бардаева П. С. к.э.н., FRM

Входные требования для освоения дисциплины:

- Четкое понимание баланса коммерческого банка, финансовых рисков и знание основных банковских продуктов; базовые знания об основных инструментах финансового рынка;
- Умение использования статистических методов для построения кривых доходностей, применяющихся для измерения волатильности оцениваемого индикатора;
- Навыки формирования аналитических заключений на основе предоставленного набора информации

Знания и навыки, полученные по итогам изучения этой дисциплины, могут применяться в будущем при освоении следующих курсов:

- Риск-менеджмент финансовых институтов

Место дисциплины в учебном плане: по выбору, 4 триместр

Краткое содержание дисциплины:

Тема 1. Роль внутреннего казначейства и его место в организационной структуре банка

Тема 2. Стратегия управления активами и пассивами

Тема 3. Система регуляторных требований к структуре активов и пассивов КБ

Тема 4. Управление ликвидностью: задачи, инструменты, результаты

Тема 5. Принципы трансфертного ценообразования

Тема 6. Управление капиталом банка: планирование и стратегия

Общая трудоемкость дисциплины: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Итоговый контроль: проект (анализ бизнес ситуации на примере одной или нескольких реально существующих банковских групп).