

АННОТАЦИЯ УЧЕБНЫХ ДИСЦИПЛИН МАГИСТЕРСКОЙ ПРОГРАММЫ «ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ И ИНСТИТУТЫ»

«Риск-менеджмент»

ФИО преподавателя: Владимир Манаев, Дмитрий Перегудов, Александр Голицын

Входные требования для освоения дисциплины:

Данный предмет основан на знаниях и умениях, приобретенных в ходе освоения целого набора финансовых дисциплин. Среди основных предметов, изучение которых требуется для освоения данного предмета можно перечислить:

1. Управление финансовыми институтами
2. Управление активами и пассивами коммерческого банка

Место дисциплины в учебном плане: по выбору, 3(третий) триместр

Краткое содержание дисциплины:

Тема 1. Роль риск-менеджмента для финансовых институтов

Тема 2. Кредитный риск в финансовых институтах

Тема 3. Рыночный риск в финансовых институтах

Тема 4. Товарный риск

Тема 5. Процентный риск, риск ликвидности и операционный риски в финансовых институтах

Тема 6. Интегрированный риск-менеджмент. Экономический капитал. Стресс-тестирование.

Общая трудоемкость дисциплины: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Итоговый контроль: Экзаменационная работа