

## **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