

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Макаренко Елена Николаевна

Должность: Ректор

Дата подписания: 03.04.2024 14:35:46

Уникальный программный ключ:

c098bc0c1041cb2a4cf926cf171d6715d99a6ae00adc8e27b55cbe1e2dbd7c78

# Система риск-менеджмента в банках

Закреплена за кафедрой **Банковское дело**

Учебный план 38.04.01.16\_1.plx

Форма обучения **очная**

## Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	2 (1.2)		Итого	
	Неделя 15 2/6			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	8	8	8	8
Практические	24	24	24	24
Итого ауд.	32	32	32	32
Контактная работа	32	32	32	32
Сам. работа	76	76	76	76
Часы на контроль	36	36	36	36
Итого	144	144	144	144

## 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

- 1.1 Цели дисциплины: развитие знаний и умений у магистранта в изучении классификации рисков, методов анализа рисков и неопределенности; выработка навыков управления рисками в сфере банковского риск-менеджмента

## 2. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

**УК-3: Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели**

**ПК-1: Способен применять научные концепции и методы исследования тенденций развития банковского сектора и финансовых рынков для обоснования решений по управлению деятельностью банка и его подразделений**

**ПК-3: Способен разрабатывать варианты управленческих решений в деятельности казначейства банка для целей управления банковскими рисками: ликвидности, валютным и процентным**

**ПК-5: Способен использовать и анализировать различные источники информации в целях управления рисками и доходностью портфеля корпоративных кредитных продуктов банка**

### В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

#### Знать:

теоретические основы исследования командной стратегии (соотнесено с индикатором УК- 3.1);  
теоретические основы исследования риска, а также терминологию дисциплины для практического использования в дальнейшей профессиональной деятельности (соотнесено с индикатором ПК- 1.1);  
 типовые приёмы моделирования и измерения риска в процессе принятия решений (соотнесено с индикатором ПК- 3.1);  
источники информации для оценки уровня банковских рисков и доходности портфеля корпоративных кредитных продуктов банка (соотнесено с индикатором ПК- 5.1)

**Уметь:**

организовать командный процесс исследования (соотнесено с индикатором УК- 3.2);  
критически оценивать существующие подходы к управлению банковскими рисками (соотнесено с индикатором ПК-1.2 );  
анализировать кредитные риски коммерческого банка и обрабатывать результаты анализа и оценки риска, использовать их в своей работе при принятии управленческих решений (соотнесено с индикатором ПК- 3.2);  
анализировать какие возможности и угрозы таит неопределенная внешняя среда для доходности портфеля корпоративных кредитных продуктов банка (соотнесено с индикатором ПК- 5.2)

**Владеть:**

выработки командной стратегии исследования (соотнесено с индикатором УК- 3.3);  
ознакомления с новыми подходами в области риск-менеджмента, а также правильная идентификация рисков (соотнесено с индикатором ПК- 1.3);  
оценки анализа типовых рисков (валютного, процентного, операционного риска и риска ликвидности коммерческого банка) (соотнесено с индикатором ПК- 3.3);  
моделирования и прогнозирования развития рискованных ситуаций в банковской деятельности, в целях управления рисками и доходностью портфеля корпоративных кредитных продуктов банка (соотнесено с индикатором ПК-5.3)