

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ «РИСК МЕНЕДЖМЕНТ»**

**Автор:** Буздалин А.В.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.02 Менеджмент  
(«Финансы и Технологии»)

**Квалификация (степень) выпускника:** Магистр

**Форма обучения:** очная

### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать способность использовать современные методы управления Корпоративными финансами для решения стратегических задач.

### **План курса:**

Тема 1. Риск и отношение к риску.

Тема 2 Простейшая модель гар-анализа. Гар переоценки.

Тема 3 Модель гар дюрации.

Тема 4 Модели мэппинга потока платежей.

Тема 5 Трансфертное ценообразование.

Тема 6 Дисперсионно-ковариационный подход VaR.

Тема 7 Модели оценки волатильности.

Тема 8 Имитационные модели.

Тема 9 Развитие VaR моделей.

Тема 10 VaR модели: выводы, приложения и ограничения.

Тема 11 Модели кредитного скоринга.

Тема 12 Рыночные модели оценки кредитного риска.

Подход основанный на кредитных спредах. Оценка годовой вероятности дефолта. Оценка вероятности дефолта на произвольном временном горизонте. Альтернативный подход.

Достоинства и недостатки модели, основанной на кредитных спредах.

Тема 13 Потери в случае банкротства.

Тема 14 Рейтинговые системы.

Тема 15 Портфельные модели.

Тема 16 Некоторые приложения моделей оценки кредитного риска.

**Аудиторные часы:** 48

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:** домашние работы, экзамен.

### **Основная литература:**

1. Энциклопедия финансового риск-менеджмента. Под редакцией А.А. Лобанова и А.В. Чугунова – М.: Альпина Паблишер, 2003. С.715-720
2. Джозеф Ф.Синки, мл. Управление финансами в коммерческом банке. – М.: Catallaxy, 1994. С.426-435