Аннотация

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Задорожная Людмила Ивановна
Должность: Проректор по учебной работе
Дата подписания: 29.04.2026 15:10:28
Уникальный программный ключ:
faa4f4d4ec2a02bc5fda751ee8dd6b40f4d6f12c

рабочей программы учебной дисциплины "*Б1.В.ДВ.04.02 Управление рыночными и кредитными рисками*"

направления подготовки бакалавров "*38.04.08 Финансы и кредит*"

профиль подготовки "*Искусственный интеллект в финансово-экономических системах*"

программа подготовки "*магистр*"

Цели и задачи учебной дисциплины (модуля)

Целями освоения дисциплины «Управление рыночными и кредитными рисками» являются формирование у магистрантов системы теоретических и практических знаний о современных технологиях управления рыночными рисками; овладение навыками анализа процессов идентификации, оценки рыночными рисков и принятия управленческих решений.

В процессе изучения дисциплины ставятся следующие **задачи:**

- изучить различные подходы к классификации рыночных рисков;

- рассмотреть структуру рыночных рисков;

- организацию работы коммерческого банка по управлению рисками;

- кредитный риск: содержание, оценка, причины и методы управления;

- проанализировать качество кредитного портфеля банка; цели ранжирования кредитов; факторы, в соответствии с которыми осуществляется ранжирование кредитов;

- факторы, вызывающие потери банка при кредитовании, цели и механизмы реализации кредитной политики.

Основные блоки и темы дисциплины

Раздел дисциплины
Теоретические основы управления финарыночными рисками
Функции управления рыночными рисками
Системы обеспечения управления рыночными рисками
Методический инструментарий управления рыночными рисками
Исследование систематических рыночных рисков

Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Управление рыночными и кредитными рисками» входит в профессиональный цикл вариативную часть дисциплин по выбору основной образовательной программы подготовки магистров по профилю 080300 «Финансы и кредит».

Дисциплина «Управление рыночными и кредитными рисками» базируется на знаниях, полученных студентами в процессе изучения таких дисциплин, как: Микроэкономика

(продвинутый уровень), Макроэкономика (продвинутый уровень), Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики.

Для полноценного освоения учебного материала по дисциплине необходимо также владеть основами математического анализа, уметь прогнозировать экономические процессы и видеть перспективы их развития. Знания, полученные студентами в ходе изучения дисциплины «Управление рыночными и кредитными рисками» могут быть использованы при изучении дисциплины «Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений».

В результате изучения дисциплины бакалавр должен обладать следующими компетенциями:

ПКУВ-1: Способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля		
ПКУВ-1.1 Консультирует по широкому спектру финансовых услуг		
широкий спектр финансовых продуктов и услуг; экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности; основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы	осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг; предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента; собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра экономических и финансовых услуг	навыками проведения консультаций по вопросам оказания финансовых услуг, в том числе о состоянии и перспективах рынка, современных тенденциях в экономике и финансах
ПКУВ-5: Способен применять методы и механизмы построения системы управления риском ликвидности и кредитным, операционным, валютным рисками		
ПКУВ-5.1 Владеет методами оценки риска ликвидности, кредитного, операционного, процентного, рыночного и валютного рисков, имеет понимание реализации механизмов построения эффективных систем управления ими		
теоретические основы оценки рыночных рисков и методы управления ими	использовать современные методики проведения анализа влияния рыночных рисков на деятельность финансовых структур и оценивать эффективность управления данными рисками	инструментами оценки и навыками определения способов минимизации риска ликвидности, кредитного, операционного, процентного, рыночного и валютного рисков

Дисциплина "Управление рыночными и кредитными рисками" изучается посредством лекций, все разделы программы закрепляются практическими, лабораторными занятиями, выполнением контрольных работ, самостоятельной работы над учебной и научно-технической литературой и завершается экзаменом.

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 72 часа, 2 зачетные еденицы.

Вид промежуточной аттестации: Зачет.

Разработчик:	Подписано простой ЭП 31.03.2026	Пригода Людмила Владимировна
Зав. кафедрой:	Подписано простой ЭП 01.04.2026	Пригода Людмила Владимировна
Зав. выпускающей кафедрой:	Подписано простой ЭП 01.04.2026	Пригода Людмила Владимировна