Аннотации дисциплин
38.04.08 Финансы и кредит
38.04.08.04 Банковское дело (Banking)

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля) Б1.О.01 Методология исследований проблем банковской и финансовой сферы / Research methods in Banking and Finance

Цель изучения дисциплины: дать возможность магистрантам конкретизировать знания среднего и продвинутого уровня в области банковского дела и финансов, помочь приобрести навыки выявления существующих проблем, нахождения научных и практических способов их разрешения, а также развить профессиональные умения применять качественные и количественные методы исследования и правильно обосновывать методологию исследования при написания научных работ в области банковского дела и финансов.

Основные разделы: введение в суть научного исследования; обоснование темы исследования; процесс и принцип научной работы, научная этика и другие вопросы, связанные с исследовательским процессом; связь между теорией и методами научных исследований; основные количественные и качественные методы в области банковского исследования; определение профессиональной и регулятивной среды, в рамках которых осуществляется исследование; базовые научные методы исследований в области банковского дела и финансов.

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения (УК-1.2);
- разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности (УК-1.3)

способен обобщать и критически оценивать результаты научных исследований и самостоятельно выполнять исследовательские проекты в области финансов и смежных областях (ОПК-3):

– сравнивает различные источники научной информации и выбирает надлежащие для проведения теоретического анализа современных проблем экономики (ОПК-3.1);

– критически оценивает и обобщает результаты научных исследований в области экономики с использованием методов сравнительного анализа (ОПК-3.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.О.02 Управление капиталом банка / Bank Capital Management

Цель изучения дисциплины: приобретение обучающимися знаний, умений и навыков в сфере управления капиталом коммерческого банка, современных методов регулирования достаточности капитала кредитной организации, основ построения стратегии развития в соответствии с регуляторными требованиями и целями банка

Основные разделы: научные школы и теории управления капиталом банка; подходы Базельского комитета к регулированию капитала банка; стратегия банка на основе критерия достаточности капитала; моделирование банковской деятельности

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности (ОПК-4):

- использует методы и модели оценки влияния различных факторов при разработке альтернативных вариантов финансово-экономических и организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности (ОПК-4.1);
- моделирует и прогнозирует последствия принятия финансово-экономических и управленческих решений (ОПК-4.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.О.03 Фундаментальные основы банковского дела / Fundamentals of Bank

Цель изучения дисциплины: предоставление магистрантам возможности углубить фундаментальные знания принципов и методов оценки банковского дела с позиции доходности и рискованности в рамках выбранного ими направления научного исследования, которое впоследствии составит основу магистерской диссертации

Основные разделы: научные подходы к оценке деятельности банка, банковской группы, банковского сектора; основы денежно-кредитного регулирования экономики, роль и риски мегарегулятора; критерии и методы выбора и обоснования релевантной финансовой модели для решения практической или исследовательской задачи

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен решать практические и (или) научно-исследовательские задачи в области финансовых отношений на основе применения знаний фундаментальной экономической науки (ОПК-1):

- описывает ключевые параметры анализируемых процессов в финансовом секторе экономики, опираясь на результаты предшествующих исследований (ОПК-1.1);
- составляет план исследования и формулирует модель описания практической ситуации в сфере финансовых отношений с теоретических позиций (ОПК-1.2)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.О.04 Методы анализа данных и машинное обучение / Data analysis methods and machine learning

Цель изучения дисциплины: формирование у студентов информационной культуры, умения видеть потребность в анализе, ставить аналитическую задачу и организовать её решение и исследование современными профильными библиотеками наиболее распространённых языков программирования (R, Python).

Основные разделы: Цели анализа данных. Анализ структурированных данных. Подготовка данных, учёт выбросов и пропусков. Определение наиболее подходящей формы представления данных: система реляционных таблиц или гиперкуб. Запросы к базе данных, основы SQL. Традиционные статистические методы анализа данных, проверка статистических гипотез, реализация в Excel, Python и R. Проблема сокращения размерности и метод главных компонент. Библиотека NumPy; Понятие больших данных. Способы организации получения знаний из больших данных. Инфраструктура сбора и хранения больших данных. Этические и правовые проблемы работы с данными; Задачи классификации в анализе данных. Наивный Байесов классификатор, метод KNN, метод “случайный лес”; Понятие машинного обучения. Концептуальная схема нейросети. Виды обучения. Задачи обучения с учителем (supervised learning) и без учителя (unsupervised learning). Проблема переобучения. Библиотека Pandas; Подходы к анализу слабоструктурированных и неструктурированных данных. Основы анализа текстов (natural language processing); Анализ данных как инструмент принятия решений. Взаимосвязь анализа данных с имитационным моделированием. Прикладные задачи анализа данных в экономических исследованиях

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем (ОПК-2):

- применяет математические методы для экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях (ОПК-2.1);
- использует национальные и международные базы данных для экономических исследований (ОПК-2.2)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.О.05 Прикладная эконометрика для финансового посредничества / Applied Econometrics for Financial Intermediation

Цель изучения дисциплины: формирование у обучающихся теоретических знаний и практических навыков по применению статистических вероятностных методов для исследования и обобщения эмпирических зависимостей экономических переменных, а также построения надежных прогнозов с целью обоснования принимаемых решений в сфере финансового посредничества

Основные разделы: Регрессионные модели пространственных данных. Модели временных рядов. Анализ панельных данных

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем (ОПК-2):

- применяет математические методы для экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях (ОПК-2.1);
- использует национальные и международные базы данных для экономических исследований (ОПК-2.2)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.О.06 Монетарная экономика / Monetary Economics

Цели изучения дисциплины: предоставление магистрантам возможности углубить знания в вопросах реализации денежно-кредитной политики через трансмиссионный механизм, нейтральность денег, денежные модели в рамках выбранного ими направления научного исследования, которое впоследствии составит основу магистерской диссертации

Основные разделы: ожидания в макроэкономике и денежно-кредитной политике; макромодели, правила предложения денег, сеньораж, облигации и перспективы нейтральности денег; макроэкономическая теория процентных ставок; деньги, банковское дело и инфляция; финансовые посредники

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен решать практические и (или) научно-исследовательские задачи в области финансовых отношений на основе применения знаний фундаментальной экономической науки (ОПК-1):

- описывает ключевые параметры анализируемых процессов в финансовом секторе экономики, опираясь на результаты предшествующих исследований (ОПК-1.1);
- составляет план исследования и формулирует модель описания практической ситуации в сфере финансовых отношений с теоретических позиций (ОПК-1.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.01 Управление стоимостью компании / Corporate Valuation

Цель изучения дисциплины: предоставление магистрантам возможности углубить знания методов разработки, алгоритмов оценки стоимости корпорации в рамках выбранного ими направления научного исследования, которое впоследствии составит основу магистерской диссертации. Результатами обучения должны стать умения вырабатывать стратегию, опираясь на системный подход к оценке стоимости корпорации, а также умения разрабатывать индикаторы достижения ее цели, исходя из имеющихся ресурсов и ограничений

Основные разделы: исходные данные для оценки корпорации; методы разработки, алгоритмы оценки стоимости корпорации; выбор типа экономико-математической модели доходной оценки для использования ее в рамках создаваемой модели оценки корпорации с учетом ограничений

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1);
- осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения (УК-1.2);
- разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности (УК-1.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.02 Управление проектами в банковском деле / Project management in Banking

Цель изучения дисциплины: освоение магистрантами базовых методологий проектного управления, как классических, так и современных, и получения навыков инициации и планирования проекта, моделирования с помощью специализированного программного обеспечения, анализа участников и построения коммуникаций, оценки рисков и результатов проекта

Основные разделы: 1) Основы проектного управления, общепринятые международные и национальные стандарты и методологии, основные понятия, система управления проектами, программа, жизненный цикл проекта, формирование паспорта (устава) и сводного плана проекта; 2) Области знаний в управлении проектами и автоматизация основных процессов управления проектами, понятия ИСУП – информационной системы управления проектами, ее место в управлении компанией / проектами. Основные средства цифровизации проектного управления, управление содержанием проекта, иерархическая структура работ, календарно-сетевое планирование, виды сетевых графиков, критический путь, критическая цепь, связи между работами, оптимизация графика, управление ресурсами. 3) Построение плана коммуникаций, управление командой, основные средства коммуникаций, управление рисками проекта, стратегии управления рисками; 4) Гибкое управление проектами, agile и его основные фреймворки (SCRUM и др)
Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы, формулируя цель, задачи, актуальность, значимость (научную, практическую, методическую и иную в зависимости от типа проекта), ожидаемые результаты и возможные сферы их применения (УК-2.1);
- видит образ результата деятельности и планирует последовательность шагов для достижения данного результата. Формирует план-график реализации проекта в целом и план контроля его выполнения (УК-2.2);
- организует и координирует работу участников проекта, способствует конструктивному преодолению возникающих противоречий и конфликтов, обеспечивает работу команды необходимыми ресурсами (УК-2.3);
- предлагает возможные пути (алгоритмы) внедрения в практику результатов проекта (или осуществляет его внедрение) (УК-2.4)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.03 Банковские коммуникации. Банковская этика / Banking Communication. The banking ethics

Цель изучения дисциплины: изучение этики и деловой терминологии в области банковского дела и финансов, развитие межкультурных коммуникаций в англоязычной деловой среде. Курс дает возможность понять основные методологические подходы к формированию этических норм; основные стандарты формирования корпоративного поведения, служебной и внеслужебной этики, а также деловой этикет; задачи, методы и предметы этики банковской деятельности, нормы этического поведения в межбанковской деятельности

Основные разделы: прозрачность финансовых посредников; конфиденциальная информация и банковская тайна; бизнес-этика; корпоративное управление; борьба с отмыванием денег и финансированием терроризма; развитие международных профессиональных отношений

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели (УК-3):

- учитывает в своей социальной и профессиональной деятельности интересы, особенности поведения и мнения (включая критические) людей, с которыми работает/взаимодействует, в том числе посредством корректировки своих действий (УК-3.1);
- предвидит результаты (последствия) как личных, так и коллективных действий (УК-3.2)

способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6):

- проводит рефлексию своей индивидуальной и/или командной работы - процесс и результаты принятия решения (УК-6.1);
- планирует профессиональную траекторию с учетом особенностей как профессиональной, так и других видов деятельности и требований рынка труда (УК-6.2);
- действует в условиях неопределенности, корректируя планы и шаги по их реализации с учетом имеющихся ресурсов (УК-6.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.04 Финансовая корпоративная ответственность и этика Financial corporate responsibility and ethics

Цель изучения дисциплины: изучение принципов корпоративной ответственности финансового бизнеса перед обществом, роли и места деловой этики в управленческой деятельности, приобретение навыков управленческого анализа деятельности компании, принятия эффективных решений в области совершенствования корпоративного управления и социальной ответственности бизнеса.

Основные разделы: корпоративное управление; факторы, влияющие на корпоративное управление, этапы корпоративного жизненного цикла; организационная культура; модели организационной культуры; корпоративная социальная ответственность финансового бизнеса; этические организации и лидерство; организационная культура и изменения; вовлеченность сотрудников, мероприятия для увеличения вовлеченности.

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия (УК-4):

- демонстрирует интегративные умения, необходимые для реферирования и аннотирования различных академических текстов (эссе, обзоров, статей и т.д.) (УК-4.1);
- представляет результаты академической и профессиональной деятельности на различных научных мероприятиях, включая международные (УК-4.2);
- владеет жанрами письменной коммуникации в академической сфере, в том числе в условиях межкультурного взаимодействия (УК-4.3)

способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия (УК-5):

- адекватно объясняет особенности поведения и мотивации людей различного социального и культурного происхождения в процессе взаимодействия с ними, опираясь на знания причин появления социальных обычаев и различий в поведении людей (УК-5.1);
- создает недискриминационную среду взаимодействия при выполнении профессиональных задач (УК-5.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.05 Научно-методологический семинар / Scientific - methodological workshop

Цели изучения дисциплины: дать возможность магистрантам конкретизировать знания, полученные в результате изучения дисциплины «Методология исследований проблем банковской и финансовой сферы» в рамках выбранного ими направления научного исследования, которое впоследствии ляжет в основу магистерской диссертации

Основные разделы: 1. Работа над темой и актуальностью исследования; 2. Как подготовить статью или тезисы для публикации; 3. Как писать магистерскую диссертацию

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

− анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1);

− осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения (УК-1.2)

способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия (УК-4):

- демонстрирует интегративные умения, необходимые для реферирования и аннотирования различных академических текстов (эссе, обзоров, статей и т.д.) (УК-4.1);
- представляет результаты академической и профессиональной деятельности на различных научных мероприятиях, включая международные (УК-4.2)

способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6):

- проводит рефлексию своей индивидуальной и/или командной работы - процесс и результаты принятия решения (УК-6.1)

способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- способен проводить научные исследования в области финансов, денежного обращения и кредита в части выявления актуальных проблем, формулирования методологических основ и постановки задач для ключевых участников процесса управления рисками (ПК-3.1)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.06 Финансовое моделирование / Financial Modeling

Цель изучения дисциплины: обучение магистрантов применению экономико-математических методов и моделей для решения прикладных задач из области управления финансами организации с использованием программных инструментальных средств

Основные разделы: Базовые понятия финансового моделирования и оптимизационный подход. Применение оптимизационных моделей при решении задач финансового управления. Методы и модели анализа динамики финансовых показателей и построения финансовых прогнозов.

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1)

способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2)

способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен осуществлять мониторинг эффективности управления рисками со всеми участниками процесса и консультировать по вопросам повышения эффективности управления рисками (ПК-4.1);
- способен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.07 Фундаментальные основы ценообразования деривативов /
Fundamental of Derivative Pricing

Цель изучения дисциплины: ознакомление студентов с основными математическими теориями ценообразования производных финансовых инструментов, формирование навыков поиска необходимых данных и решения соответствующих задач с использованием информационных технологий

Основные разделы: фьючерсы и опционы: сущность, разновидности, области применения; теория ценового арбитража. Биноминальная оценка стоимости европейских опционов; винеровский процесс; броуновское движение как модель ценовой динамики; основы стохастического интегрирования; формула Ито; модель Блэка-Шоулза; «Греки» (параметры – частные производные); статистические методы исследования ценовых данных; применение машинного обучения для анализа ценовых данных

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- способен проводить научные исследования в области финансов, денежного обращения и кредита в части выявления актуальных проблем, формулирования методологических основ и постановки задач для ключевых участников процесса управления рисками (ПК-3.1)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.08 Финансовые технологии / FinTech

Цель изучения дисциплины: развитие у студентов способности применять инновационные финансовые и банковские технологии. Результатами обучения должны стать умения проводить анализ в области денежно-кредитной политики и финансового сектора с использованием современных финансовых и банковских технологий, а также умения прогнозировать последствия проектно-экономических и финансовых решений с использованием инновационных технологий

Основные разделы: технические средства финансовых и банковских технологий; процедурное обеспечение финансовых и банковских технологий; информационное обеспечение финансовых и банковских технологий

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- использует при проектировании в области денежно-кредитной политики и для банковского сектора современный инструментарий определения уровней ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2.1);
- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.09 Банковское и финансовое право. Финансовый мониторинг /
Banking and Finance Law. Anti-money laundering

Цель изучения дисциплины: предоставление магистрантам возможности углубить знания принципов и методов получения значимой информации в сфере банковского права и для раскрытия или пресечения финансово-экономических преступлений, противодействия отмыванию денег (ПОД) в рамках выбранного ими направления научного исследования, которое впоследствии составит основу магистерской диссертации

Основные разделы: нормативная база банковской деятельности; системный подход к выявлению факторов, порождающих проблемы в сфере обеспечения финансово-экономической безопасности; методы разработки, алгоритмы внедрения и инструменты оценки эффективности системы управления финансовыми рисками; угрозы и уязвимость участников системы ПОД: перенастраивание системы управления рисками с учетом ситуационного подхода

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1)

способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен осуществлять мониторинг эффективности управления рисками со всеми участниками процесса и консультировать по вопросам повышения эффективности управления рисками (ПК-4.1);
- с пособен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.10 Стратегия и организация деятельности финансовых институтов / Strategy and Organisation in Financial Institutions

Цель изучения дисциплины: формирования у магистров навыков принятия управленческих решений с целью разработки стратегии развития финансовых институтов и организации их деятельности

Основные разделы: финансирование организации, портфельная стратегия и инвестиционные решения; увязка корпоративной стратегии с показателями рынков капитала; коммуникации с инвесторами; обеспечение соответствия слияния и поглощения и других сделок общей стратегии; корпоративное планирование

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1)

способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.11 Финансовый инжиниринг / Financial engineering

Цель изучения дисциплины: формирование у магистров системы теоретических и прикладных знаний, применяемых при проектировании, разработке и реализации инновационных финансовых инструментов/финансовых технологий для реализации инвестиционной стратегии бизнеса

Основные разделы: теоретические основы финансового инжиниринга; методические подходы к оценке результативности финансовых решений; инструменты финансового конструирования

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности (УК-1.3)

способен проектировать, планировать, координировать интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1):

- разрабатывает проект интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1.1)

способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- определяет принципы, цель и алгоритм формирования регулирования процесса управления рисками с привлечением современного финансового инструментария (ПК-3.2)

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ДВ.01.01 Финансовое инвестирование и риск-менеджмент / Financial Investment Risk Management

Цель изучения дисциплины: изучения дисциплины: углубленное понимание ключевых подходов к системе риск-менеджмента, формирование навыков управления инвестиционным портфелем

Основные разделы: финансовые активы в современной портфельной теории; подходы к количественной оценке неопределенности; риск и доходность финансовых активов: инструментарий оценки для портфеля; разработка инвестиционного портфеля финансовых активов для инвестора; управление целевым инвестиционным портфелем; современные тенденции в управлении инвестиционным портфелем

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы, формулируя цель, задачи, актуальность, значимость (научную, практическую, методическую и иную в зависимости от типа проекта), ожидаемые результаты и возможные сферы их применения (УК-2.1)

способен проектировать, планировать, координировать интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1):

- разрабатывает проект интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1.1);
- реализует план построения системы управления рисками с использованием современного инструментария (ПК-1.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ДВ.01.02 Поведенческая экономика / Behavioral economics

Цель изучения дисциплины: изучение ознакомление магистрантов с теоретическим инструментарием и современными эмпирическими исследованиями в области поведенческой экономики, развития навыков определения влияния социальных, когнитивных и эмоциональных факторов на принятие экономических решений банками и финансовыми организациями и последствий этих воздействий на рыночные переменные.

Основные разделы: проблемы рационального принятия решений в банковской сфере, последствия эвристики и предвзятости для анализа решения, межвременные предпочтения, динамическое принятие решений, экспоненциальное и гиперболическое дисконтирование, методы измерения временных предпочтений, противоречия и ограничения; модели теории игр: эволюционные игры, психологические игры; экспериментальные методы оценки финансовых рисков.

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы, формулируя цель, задачи, актуальность, значимость (научную, практическую, методическую и иную в зависимости от типа проекта), ожидаемые результаты и возможные сферы их применения (УК-2.1)

способен проектировать, планировать, координировать интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1):

- разрабатывает проект интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1.1);
- реализует план построения системы управления рисками с использованием современного инструментария (ПК-1.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины
Б1.В.ДВ.02.01 Денежно-кредитная и налогово-бюджетная политика / Monetary and Fiscal policy

Цель изучения дисциплины: предоставление магистрантам возможности углубить знания в вопросах реализации налогово-бюджетной и денежно-кредитной политики, методов и инструментов регулирования экономических процессов со стороны государства и мегарегулятора

Основные разделы: содержание, объекты и формы финансового регулирования; методы финансового регулирования, их характеристика. фискальная политика государства; принципы, методы и инструменты денежно-кредитного регулирования; ожидания в макроэкономике и денежно-кредитной политике; макропруденциальное стресс-тестирование; банковское регулирование и надзор

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- способен проводить научные исследования в области финансов, денежного обращения и кредита в части выявления актуальных проблем, формулирования методологических основ и постановки задач для ключевых участников процесса управления рисками (ПК-3.1);
- определяет принципы, цель и алгоритм формирования регулирования процесса управления рисками с привлечением современного финансового инструментария (ПК-3.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины
Б1.В.ДВ.02.02 Актуальные проблемы финансов / Actual problems of finance

Цель изучения дисциплины: углубление знаний по вопросам актуальных проблем теории и практики организации финансов экономических субъектов и финансовой базы деятельности органов государственной власти и местного самоуправления

Основные разделы: проблемы формирования и использования средств государственного и территориальных бюджетов РФ; финансовая политика и её особенности на современном этапе развития общества; направления совершенствования финансового механизма в условиях перманентного экономического кризиса; проблемы интеграции финансовой системы РФ в международные финансовые рынки и институты

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- способен проводить научные исследования в области финансов, денежного обращения и кредита в части выявления актуальных проблем, формулирования методологических основ и постановки задач для ключевых участников процесса управления рисками (ПК-3.1);
- определяет принципы, цель и алгоритм формирования регулирования процесса управления рисками с привлечением современного финансового инструментария (ПК-3.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ДВ.03.01 Стратегическое распределение активов /
Strategic Asset Allocation

Цель изучения дисциплины: предоставление студентам - магистрантам возможности углубить фундаментальные знания по стратегиям/стратегическим подходам распределения активов, которые и будут, в конечном итоге, влиять на прибыльность от вложенных средств.

Основные разделы: управление портфелем активов, тактическое и гибридное распределение активов, проблемы с распределением активов, научные исследования о распределении активов

Планируемыми результатами обучения (перечень компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины): способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- предлагает возможные пути (алгоритмы) внедрения в практику результатов проекта (или осуществляет его внедрение) (УК-2.4);

способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- использует при проектировании в области денежно-кредитной политики и для банковского сектора современный инструментарий определения уровней ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2.1);
- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2).

Форма промежуточной аттестации: зачет.

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ДВ.03.02 Альтернативные активы / Alternative Assets

Цель изучения дисциплины: углубленное понимание студентами природы и рисков вложений в неклассические активы с целью получения прибыли в долгосрочной перспективе

Основные разделы: понятие и типы альтернативных активов; альтернативные активы для диверсификации инвестиционного портфеля с целью снижения рисков; ликвидные альтернативные инвестиции

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- предлагает возможные пути (алгоритмы) внедрения в практику результатов проекта (или осуществляет его внедрение) (УК-2.4)

способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- использует при проектировании в области денежно-кредитной политики и для банковского сектора современный инструментарий определения уровней ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2.1);
- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2).

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины
Б1.В.ДВ.04 Банковское управление и надзор / Bank Management and Supervision

Цель изучения дисциплины: углубление знаний по вопросам банковского надзора, а также системы управления банком. Результатами обучения должны стать умения выявлять и решать актуальные проблемы банковского надзора, в т.ч. с учетом перспектив изменения нормативно-правовой базы

Основные разделы: система банковского менеджмента и оценка ее качества; банковский надзор; трехкомпонентная модель Базельского соглашения; подходы к оценке активов, взвешенных с учетом риска; стресс тестирование; система управления рисками в банке; понятие интегрированного управления рисками; система интегрированного риск-менеджмента

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6):

- планирует профессиональную траекторию с учетом особенностей как профессиональной, так и других видов деятельности и требований рынка труда (УК-6.2)

способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2);
- организует консультирование по вопросам поддержания устойчивого функционирования интегрированной системы управления рисками (ПК-4.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины
Б1.В.ДВ.04 Структурированные финансы и страхование / Structured Finance and Insurance

Цель изучения дисциплины: углубление знаний по вопросам управления, оценки, повышения доходности и регулирования новых инструментов финансового ранка - структурированных продуктов. Результатами обучения должны стать умения выявлять и решать актуальные проблемы управления структурированными финансами

Основные разделы: понятие структурированных финансов, цель и задачи; структурированные финансовые продукты: Equity-linked note, Reverse Convertible, Ladder bond, Range Accrual, Booster и др.; страховые компании на рынке структурированных финансов

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6):

- планирует профессиональную траекторию с учетом особенностей как профессиональной, так и других видов деятельности и требований рынка труда (УК-6.2)

способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2);
- организует консультирование по вопросам поддержания устойчивого функционирования интегрированной системы управления рисками (ПК-4.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к программе учебной практики
Б2.О.01(У) Ознакомительная / Academic internship

Цель практики: профессионально-практическая подготовка обучающихся

Основные этапы: подготовительный этап, ознакомительный этап, аналитический этап: анализ рыночной среды финансовых организаций региона, оценка деятельности организации с учетом темы магистерской диссертации, заключительный этап

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними УК-1.1
- осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения (УК-1.2);
- разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности (УК-1.3)

способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия (УК-4):

- демонстрирует интегративные умения, необходимые для реферирования и аннотирования различных академических текстов (эссе, обзоров, статей и т.д.) (УК-4.1);
- представляет результаты академической и профессиональной деятельности на различных научных мероприятиях, включая международные (УК-4.2);
- владеет жанрами письменной коммуникации в академической сфере,

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности (ОПК-4):

- использует методы и модели оценки влияния различных факторов при разработке альтернативных вариантов финансово-экономических и организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности (ОПК-4.1);
- моделирует и прогнозирует последствия принятия финансово-экономических и управленческих решений (ОПК-4.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к программе учебной практики
Б2.О.02(У) Научно-исследовательская работа / Applied research project

Цель практики: подготовка к самостоятельной научно-исследовательской работе обучающихся.

Основные этапы: подготовительный этап - планирование НИР; ознакомительный этап: ознакомление с тематикой научно-исследовательских работ по выбранной тематике; формулировка темы исследования; непосредственное выполнение научно-исследовательской работы; аналитический этап: анализ основных показателей деятельности организации, рисков, планов стратегического развития; корректировка плана проведения НИР в соответствии с полученными результатами; заключительный этап.
Планируемые результаты обучения (перечень компетенций):
способен решать практические и (или) научно-исследовательские задачи в области финансовых отношений на основе применения знаний фундаментальной экономической науки (ОПК-1):

- описывает ключевые параметры анализируемых процессов в финансовом секторе экономики, опираясь на результаты предшествующих исследований (ОПК-1.1);
- составляет план исследования и формулирует модель описания практической ситуации в сфере финансовых отношений с теоретических позиций ОПК-1.2);

способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем (ОПК-2):

- применяет математические методы для экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях (ОПК-2.1);
- использует национальные и международные базы данных для экономических исследований (ОПК-2.2);

способен обобщать и критически оценивать результаты научных исследований и самостоятельно выполнять исследовательские проекты в области финансов и смежных областях (ОПК-3):

- сравнивает различные источники научной информации и выбирает надлежащие для проведения теоретического анализа современных проблем экономики (ОПК-3.1);
- критически оценивает и обобщает результаты научных исследований в области экономики с использованием методов сравнительного анализа (ОПК-3.2).

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к программе производственной практики
Б2.В.01(П) Практика по профилю профессиональной деятельности /
Practical training in professional field

Цель практики: профессионально-практическая подготовка обучающихся

Основные этапы: подготовительный этап; ознакомительный этап: учетная политика; схема управления организации; система управления рисками; аналитический этап: анализ основных показателей деятельности организации, рисков, планов стратегического развития, заключительный этап

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1):

- анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними УК-1.1
- осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения (УК-1.2);
- разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности (УК-1.3)

способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2):

- разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы, формулируя цель, задачи, актуальность, значимость (научную, практическую, методическую и иную в зависимости от типа проекта), ожидаемые результаты и возможные сферы их применения (УК-2.1);
- видит образ результата деятельности и планирует последовательность шагов для достижения данного результата. Формирует план-график реализации проекта в целом и план контроля его выполнения (УК-2.2);
- организует и координирует работу участников проекта, способствует конструктивному преодолению возникающих противоречий и конфликтов, обеспечивает работу команды необходимыми ресурсами (УК-2.3);
- предлагает возможные пути (алгоритмы) внедрения в практику результатов проекта (или осуществляет его внедрение) (УК-2.4)

способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели (УК-3):

- учитывает в своей социальной и профессиональной деятельности интересы, особенности поведения и мнения (включая критические) людей, с которыми работает/взаимодействует, в том числе посредством корректировки своих действий (УК-3.1);

- предвидит результаты (последствия) как личных, так и коллективных действий (УК-3.2)

способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия (УК-5):

- адекватно объясняет особенности поведения и мотивации людей различного социального и культурного происхождения в процессе взаимодействия с ними, опираясь на знания причин появления социальных обычаев и различий в поведении людей (УК-5.1);
- создает недискриминационную среду взаимодействия при выполнении профессиональных задач (УК-5.2)

способен проектировать, планировать, координировать интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1):

- разрабатывает проект интегрированную комплексную деятельность подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации, банка через цифровые технологии, инжиниринг (ПК-1.1);
- реализует план построения системы управления рисками с использованием современного инструментария (ПК-1.2)

способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- использует при проектировании в области денежно-кредитной политики и для банковского сектора современный инструментарий определения уровней ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2.1);
- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2)

способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен осуществлять мониторинг эффективности управления рисками со всеми участниками процесса и консультировать по вопросам повышения эффективности управления рисками (ПК-4.1);
- способен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2);

- организует консультирование по вопросам поддержания устойчивого функционирования интегрированной системы управления рисками (ПК-4.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к программе производственной практики Б2.В.02(П) Научно-исследовательская работа / Applied research project

Цель практики: подготовка обучающихся к осуществлению научно-исследовательских проектов в области финансов и кредита

Основные этапы: подготовительный этап: уточнение плана НИР на кафедре в период рубежных контролей с учетом современных данных. цели исследования и полученных результатов; аналитический этап: анализ основных показателей деятельности организации, рисков, планов стратегического развития, заключительный этап

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций):
способен разрабатывать, внедрять и использовать интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (УК-4):

- демонстрирует интегративные умения, необходимые для реферирования и аннотирования различных академических текстов (эссе, обзоров, статей и т.д.) (УК-4.1);
- представляет результаты академической и профессиональной деятельности на различных научных мероприятиях, включая международные (УК-4.2);
- владеет жанрами письменной коммуникации в академической сфере, в том числе в условиях межкультурного взаимодействия (УК-4.3);

способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6):

- проводит рефлексию своей индивидуальной и/или командной работы - процесс и результаты принятия решения (УК-6.1);
- планирует профессиональную траекторию с учетом особенностей как профессиональной, так и других видов деятельности и требований рынка труда (УК-6.2);
- действует в условиях неопределенности, корректируя планы и шаги по их реализации с учетом имеющихся ресурсов (УК-6.3);

способен проводить научные исследования по разработке методологических основ стратегического регулирования процесса управления рисками

в развитии финансовых систем, кредитных организаций, учитывая спрос в новых финансовых продуктах и проблемы внедрения инновационных финансовых технологий (ПК-3):

- способен проводить научные исследования в области финансов, денежного обращения и кредита в части выявления актуальных проблем, формулирования методологических основ и постановки задач для ключевых участников процесса управления рисками (ПК-3.1);
- определяет принципы, цель и алгоритм формирования регулирования процесса управления рисками с привлечением современного финансового инструментария (ПК-3.2).

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины
ФТД.01 Корпоративное налогообложение и регулирование / Corporate Taxation and Regulation

Цель изучения дисциплины: углубление знаний по вопросам налогообложения и налогового планирования в корпорации, а также налогового регулирования по стороны государства. Результатами обучения должны стать умения выявлять и решать актуальные проблемы налогообложения компаний, в т.ч. с учетом перспектив изменения налогового законодательства.

Основные разделы: основы налогообложения корпораций; международные стратегии налогового планирования; трансфертное ценообразование; система государственного регулирования налогового планирования; участие банков в налоговом мониторинге; разработка схемы налогового планирования корпорации; оценка рисков

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен разрабатывать, консультировать, внедрять интегрированную систему управления финансовыми рисками в том числе, разрабатывать для заинтересованных лиц индикаторы и критерии допустимого (существенного) уровня риска, определять адекватные способы воздействия на риск, осуществлять контроль и оценку эффективности системы управления рисками (ПК-4):

- способен осуществлять мониторинг эффективности управления рисками со всеми участниками процесса и консультировать по вопросам повышения эффективности управления рисками (ПК-4.1);
- способен разработать совместное предложение по повышению эффективности управления рисками со всеми участниками процесса (ПК-4.2);
- организует консультирование по вопросам поддержания устойчивого функционирования интегрированной системы управления рисками (ПК-4.3)

Форма промежуточной аттестации: зачет

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)
ФТД.02 Количественные методы в финансах / Quantitative Methods in Finance

Цель изучения дисциплины: ознакомление магистрантов с математическими основами управления финансами и финансовыми рисками; освоение магистрантами основных математических методов и приемов, необходимых для проведения финансового анализа; развитие навыков работы с необходимым для этого программным обеспечением.

Основные разделы: вероятностные методы в финансах; меры риска и портфельный анализ; численные методы в финансах

Планируемые результаты обучения (перечень компетенций): способен применять инновационные финансовые технологии для разработки проекта интегрированной системы управления рисками, включая уточнение уровня ключевых индикаторов рисков и предельно допустимого уровня для существенных и критических рисков (ПК-2):

- оценивает последствия и риски проектно-экономических решений с использованием инновационных технологий для эффективного контроля за интегрированной системой управления рисками и выбора альтернативного инвестирования (ПК-2.2)

Форма промежуточной аттестации: зачет