

21-24 мая 2024

Управление рисками в банкинге

Образовательный курс для НИУ ВШЭ

Пифтанкин Геннадий
Гулюгина Татьяна
Булусова Лидия
Блок «Риски», Сбер

Описание курса

Интенсивное погружение в тему управления основными рисками банков при помощи методов моделирования и ML за 4 занятия (+ задания для выполнения дома) вместе с сотрудниками Рисков Сбера.

Расскажем:

- Как у банка возникает необходимость принимать на себя риск,
- Какие виды риска специфичны для банков,
- В чем измеряется риск и какие модели помогают банку точно оценивать риск и управлять им.

Научим на практических примерах:

- Как определять значимые риск-метрики и делать их оценку,
- Как выявлять риск-факторы и подходящие для их описания модели,
- Как оценивать стоимость базовых финансовых инструментов.

Обеспечим возможность получить сертификат о прохождении:

- Предложим задания для самостоятельного выполнения,
- Проверим задания и обсудим их решения,
- Отметим сертификатами о прохождении успешных участников.

Программа курса

Занятие 1: Банк и риск аппетит.

Говорим о бизнес-модели банка и источниках основных рисков. Расскажем, что такое баланс с точки зрения банка и с точки зрения математика, с и как математические модели помогают банкам избегать участи Silicon Valley Bank и подобных.

Занятие 2: Риск ликвидности.

На второй встрече более подробно затронем вопрос ликвидности. Определимся с тем, что это и почему ликвидность критически важна для функционирования банка, порассуждаем, когда успешные заёмщики и вкладчики становятся источником риска и разберём способы управления риском ликвидности.

Занятие 3: Кредитный риск.

Третья встреча посвящена классическому банковскому продукту – кредиту, который по сложности моделирования соперничает со сложными деривативами. Мы рассмотрим кредитно-деривативную сделку, обсудим основные элементы прайсигна кредита: стохастические процессы для моделирования процентной ставки и кредитного качества, модели для оценки вероятности дефолта и связи между моделируемыми величинами.

Занятие 4: Рыночный риск и модели.

На завершающей четвёртой встрече фокус перейдёт на моделирование рыночных риск-факторов. Мы посмотрим, как математические модели и методы машинного обучения помогают банкам измерять и контролировать риски, сопряжённые с движениями на финансовых рынках.

Расписание курса и контакты

- 17-21 мая - Регистрация на курс (обязательна).
- 21 мая - Занятие 1: Банк и риск аппетит.
- 22 мая - Занятие 2: Риск ликвидности.
- 23 мая - Занятие 3: Кредитный риск.
- 24 мая - Занятие 4: Рыночный риск и модели.
- Финальное тестирование (онлайн).



Регистрация на курс

Для регистрации на курс напишите нам в Telegram-группе (QR код группы выше)

Место проведения курса

НИУ ВШЭ(Покровский бульвар, д.11)

Связь с организаторами

Для связи с организаторами вы можете использовать ту же Telegram-группу, что и для регистрации.