

Федеральное государственное образовательное бюджетное  
учреждение высшего образования  
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»  
(Финансовый университет)  
Департамент банковского дела и монетарного регулирования  
Финансового факультета

СОГЛАСОВАНО

Директор по рискам

АО «ОХК «Уралхим»

Н.И. Тутова

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания Департамента

от 30 августа 2023г. № 1

Руководитель Департамента

М.А. Абрамова

Примерный перечень тем ВКР на 2023/2024 уч. г.

Финансовый факультет

Программа магистратуры по направлению подготовки

38.04.08 - Финансы и кредит,

направленность программы: "Риск-менеджмент на финансовых рынках"

Наименование ОП (выпускающий департамент)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
«Риск-менеджмент на финансовых рынках» Департамент банковского дела и монетарного регулирования	«АО «ОХК «Уралхим»	1. Тренды и направления развития макроprudенциального регулирования современных условиях (на материалах национального регулятора и участников финансового рынка)
		2. Механизм микроprudенциального регулирования, оценка его влияния на финансовую (деловую) активность на финансовых рынках (на материалах регулятора и конкретных участников финансового рынка)
		3. Доверие к институтам финансового рынка, критерии и способы его количественной оценки (на примере институтов финансового рынка)
		4. Система оценки финансовой устойчивости институтов финансового рынка, направления ее трансформации (выбрать сегмент рынка, его участников)

Наименование ОП (выпускающий департамент)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
		<p>5. Стратегия и тактика урегулирования несостоятельности кредитной организации (участника финансового рынка, банка) на макроуровне</p> <p>6. Бизнес-модели деятельности институтов финансового рынка, оценка риск-профиля и влияния на финансовую устойчивость (на материалах участников финансового рынка по выбору)</p> <p>7. Регулирование деятельности банковских групп (финансовых холдингов): проблемы оценки финансовой стабильности, направления совершенствования (на материалах банковских групп)</p> <p>8. Стратегические риски и риск-аппетит коммерческого банка (другого финансового института), способы оценки и управление (на примере конкретного участника рынка, банка)</p> <p>9. Стратегии управления риском и доходностью института финансового рынка в условиях цифровизации (на примере участника рынка, по выбору)</p> <p>10. Формирование системы внутренних лимитов как механизм управления рисками на операционном уровне (на конкретном примере участникам рынка, по выбору)</p> <p>11. Сценарное моделирование в системе управления риск-менеджмента: область и механизм применения (на материалах участника финансового рынка)</p> <p>12. Модельный риск коммерческого банка (института финансового рынка): его оценка и управление (на материалах участника финансового рынка)</p> <p>13. Портфельный подход в системе управления кредитным риском (на материалах субъекта финансового рынка)</p> <p>14. Методы ценообразования на банковские продукты в системе риск-менеджмента (на примере банка)</p> <p>15. Регулирование дисбалансов в срочной структуре</p>

Наименование ОП (выпускающий департамент)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
		банковских операций ( на примере банка, другого участника, по выбору)
		16. Процентная политика кредитных организаций в условиях геополитических ограничений и современной модели регулирования на национальном уровне (на примере конкретного банка)
		17. Развитие рынка долгосрочных инвестиций: современные преобразования в национальном механизме финансирования экономического роста (на материалах Банка России, МЭР)
		18. Методы стресс-тестирования, особенности их применения и совершенствования (на примере конкретного участника финансового рынка)
		19. Использование внутренних рейтингов в системе управления кредитным риском на оперативном и портфельном уровнях (на примере конкретного участника финансового рынка)
		20. Направления организации управления структурными рисками в коммерческом банке (участников финансового рынка), пути совершенствования (на примере конкретного банка)
		21. Развитие методов организации системы управления нефинансовыми рисками в коммерческом банке (финансовый институт по выбору)
		22. Метрики доходности, скорректированные на риск (RAROC, RORWA) и их применение в риск-менеджменте (на примере конкретного банка)
		23. Проблемные активы (банка, другого участника): современная практика идентификации, оценки и управления (на примере конкретного банка, другого участника рынка)
		24. Стратегии и методы управление капиталом в условиях возрастающих рисков неопределенности экономического развития (на примере конкретного банка, другого участника рынка)
		25. Управление операционными рисками в кредитных организациях в современных условиях(на примере конкретного банка, другого

Наименование ОП (выпускающий департамент)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
		<p>участника рынка)</p> <p>26. Направления развития модели оценки рыночных рисков (можно выбрать определенный подвид)</p> <p>27. Цифровые технологии на финансовом рынке: новые возможности и риски (на примере конкретного банка, другого участника рынка))</p>