

Травкина, Елена Владимировна.

Управление рисками в современном банке: учебное пособие / Е.В. Травкина, Е.И. Мешкова, —Москва : КНОРУС, 2021. —218 с. — (Магистратура).

Оглавление

Тема 1. Теоретические основы управления рисками в современном банке.....	5
1.1. Содержание и критерии классификации банковских рисков.....	5
1.2. Нормативно-правовые основы регулирования банковских рисков.....	11
1.3. Основы фундаментальной концепции риск-менеджмента в коммерческом банке: понятие и характеристика ожидаемых и непредвиденных потерь.....	16
1.4. Обзор основных концепций финансового менеджмента.....	18
Тема 2. Система управления банковскими рисками в современном коммерческом банке.....	29
2.1. Эволюция теории и практики риск-менеджмента в банковском секторе.....	29
2.2. Роль и место риск-менеджмента в общей системе стратегического управления банком.....	33
2.3. Принципы формирования и структура системы управления банковскими рисками в современном коммерческом банке.....	47
2.4. Построение «карты рисков».....	54
2.5. Этапы управления рисками: идентификация риска и определение источников риска; оценка риска; управление и снижение риска; контроль и мониторинг риска.....	58
2.6. Базельские стандарты управления рисками и их развитие в современных условиях.....	63
Тема 3. Управление кредитным риском в коммерческом банке.....	69
3.1. Сущность и источники кредитного риска.....	69
3.2. Принципы управления кредитным риском.....	80
3.3. Методы оценки и управления кредитным риском в коммерческом банке.....	81

3.4. Причины, содержание и новации внедрения IFRS 9 «Финансовые инструменты» в международной и российской практике.....	93
3.5. Модель прогнозной оценки ожидаемых кредитных убытков клиентов при мониторинге и оценке кредитного риска.....	97
3.6. Алгоритм учета прогнозной макроэкономической информации при использовании моделей обесценения ожидаемых убытков в банке.....	99
3.7. Использование оценки кредитного риска в ценообразовании банковских продуктов.....	102
3.8. Основы портфельного управления кредитным риском в коммерческом банке.....	105
Тема 4. Управление риском несбалансированной ликвидности.....	115
4.1. Понятие ликвидности банка.....	115
4.2. Основные методы управления ликвидностью.....	117
4.3. Риск потери ликвидности. Методы оценки ликвидности.....	121
4.4. Роль трансфертного ценообразования в управлении ликвидностью банка.....	129
4.5. Стресс-тестирование риска потери ликвидности.....	141
Тема 5. Управление рыночным риском в коммерческом банке.....	157
5.1. Понятие рыночного риска, его виды и развитие регулирования.....	157
5.2. Методы оценки рыночного риска.....	160
5.3. Процентный риск банковской книги: понятие и принципы управления.....	167
5.4. Основные методы оценки процентного риска банковской книги.....	168
5.5. Стресс-тестирование рыночного риска.....	175
5.6. Методы управления рыночным риском.....	178
Тема 6. Управление нефинансовыми рисками коммерческого банка: операционные, репутационные, правовые, стратегические и кадровые риски.....	188
6.1. Место и роль нефинансовых рисков в системе риск-менеджмента коммерческого банка.....	188
6.2. Сущность, виды и источники операционного риска.....	190
6.3. Организация управления операционным риском: методы управления, контроля и ограничения операционного риска.....	192
6.4. Регулирование операционного риска со стороны Банка России ...	194
6.5. Сущность, виды и факторы репутационного риска.....	199
6.6. Понятие, факторы и методы управления правовым риском.....	202
6.7. Характеристика стратегических и кадровых рисков в банковской сфере, методы их оценки и минимизации.....	205
Библиографический список.....	211