

Федеральное государственное образовательное бюджетное  
учреждение высшего образования  
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»  
(Финансовый университет)

Кафедра банковского дела и монетарного регулирования  
Финансового факультета

СОГЛАСОВАНО

Банк ВТБ ПАО

Член Правления

М.Д. Кондратенко

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания Кафедры

от 28 августа 2024 г. № 1

Заведующий Кафедрой

М.А. Абрамова

Примерный перечень тем ВКР на 2024/2025 уч. г.

Финансовый факультет

Программа магистратуры по направлению подготовки

38.04.08 - Финансы и кредит,

направленность программы: «Управление финансовыми рисками:

прикладная аналитика и технологии в банках»

Наименование ОП (выпускающая кафедра)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
«Управление финансовыми рисками: прикладная аналитика и технологии в банках»	Банк ВТБ ПАО	1. Макропруденциальное регулирование, его механизм и оценка влияния на финансовую стабильности банковского сектора (на материалах национального регулятора и коммерческих банков)
		2. Трансмиссионный механизм микропруденциального регулирования, оценка его влияния на финансовую (деловую) активность (на материалах регулятора и коммерческих банков)
		3. Доверие к институтам финансового рынка, критерии и способы его количественной оценки (на примере кредитных организаций)
		4. Система оценки и управление финансовой устойчивостью в коммерческого банка в условиях неопределенности
		5. Стратегии урегулирования несостоятельности, их оценка эффективности (на макроуровне или

Наименование ОП (выпускающая кафедра)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
		микроуровне, по выбору)
		6. Бизнес-модели кредитных организаций, оценка их риск-профиля и влияния на финансовую устойчивость (на материалах кредитных организаций)
		7. Регулирование деятельности банковских групп (финансовых холдингов): проблемы оценки финансовой стабильности, направления совершенствования (на материалах банковских групп)
		8. Стратегические риски и риск-аппетит коммерческого банка в условиях цифровой трансформации
		9. Стратегии управления риском и доходностью коммерческого банка в нестабильной макроэкономической среде
		10. Формирование системы внутренних лимитов как механизм управления рисками коммерческого банка на операционном уровне (на конкретном примере)
		11. Цифровая операционная эффективность, способы оценки и управление
		12. Сценарное моделирование в системе риск-менеджмента коммерческого банка
		13. Модельный риск коммерческого банка: его оценка и управление
		14. Портфельный подход в системе управления кредитным риском (на материалах кредитных организаций)
		15. Методы ценообразования на банковские продукты в системе риск-менеджмента (на примере банка)
		16. Регулирование дисбалансов в срочной структуре банковских операций (на примере коммерческого банка)
		17. Стратегии управления процентным риском в коммерческом банке, оценка их эффективности
		18. Развитие рынка долгосрочных инвестиций: современные преобразования в национальном механизме финансирования экономического роста (на материалах Банка России, МЭР)
		19. Методы стресс-тестирования, особенности их применения и совершенствования (на примере



Наименование ОП (выпускающая кафедра)	Организация-работодатель, согласовавший примерный перечень	Перечень примерных тем ВКР
		коммерческих банков)
		20. Использование внутренних рейтингов в системе управления кредитным риском на оперативном и портфельном уровнях (на примере коммерческих банков)
		21. Направления организации управления структурными рисками в коммерческом банке, пути совершенствования (на примере конкретного банка)
		22. Методы организации системы управления нефинансовыми рисками на уровне экосистем
		23. Метрики доходности, скорректированные на риск (RAROC, RORWA) и их применение в риск-менеджменте (на примере конкретного банка)
		24. Проблемные активы банка: современная практика идентификации, оценки и управления (на примере конкретного банка)
		25. Стратегии и методы управление капиталом в условиях возрастающих рисков неопределенности экономического развития (на примере конкретного банка)
		26. Управление операционными рисками в кредитных организациях в современных условиях (на примере конкретного банка)
		27. Направления развития модели оценки рыночных рисков (можно выбрать определенный подвид)
		28. Модели оценки влияния экологических рисков на финансовое состояние заемщика банка
		29. Цифровые финансовые активы: риски и управление
		30. Противодействие недобросовестным практикам в условиях цифровизации, особенности финансовых услуг
		31. Риски и возможности коммерческого банка в условиях цифровизации, оценка и управление
		32. Цифровые технологии на финансовом рынке: новые возможности и риски (на примере конкретного банка, другого участника рынка))