ШКОЛА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Совместный проект ВТБ и ВШЭ

Миссия, цели и задачи Школы управления рисками ВТБ

Миссия

- Помогать молодым специалистам раскрывать их интеллектуальный потенциал, создавая технологичные финансовые решения

Актуальность

- Высокий спрос со стороны студентов на работу в ВТБ
- Низкий уровень практической подготовки студентов
- Требования к комплексным знаниям и навыкам со стороны ВТБ

Цели

- Подготовка современных риск-аналитиков и риск-менеджеров

Задачи

- Преподавание финансовых дисциплин с акцентом на **практику**
- Выполнение прикладных проектов
- Развитие у студентов навыков и умений как самостоятельного решения практических задач, так и работы в команде
- **Создание сообщества** специалистов в управлении рисками в Самаре

Школа управления рисками ВТБ

Новый формат подготовки креативных профессионалов в области риск-менеджмента

Преподаватели – практики: сотрудники ВТБ, практики-эксперты НИУ ВШЭ, с сертификатами CFA и FRM

Площадка для **разработки и внедрения data-science решений в риск-менеджменте**

Интеллектуальное пространство для обмена междисциплинарными знаниями и идеями

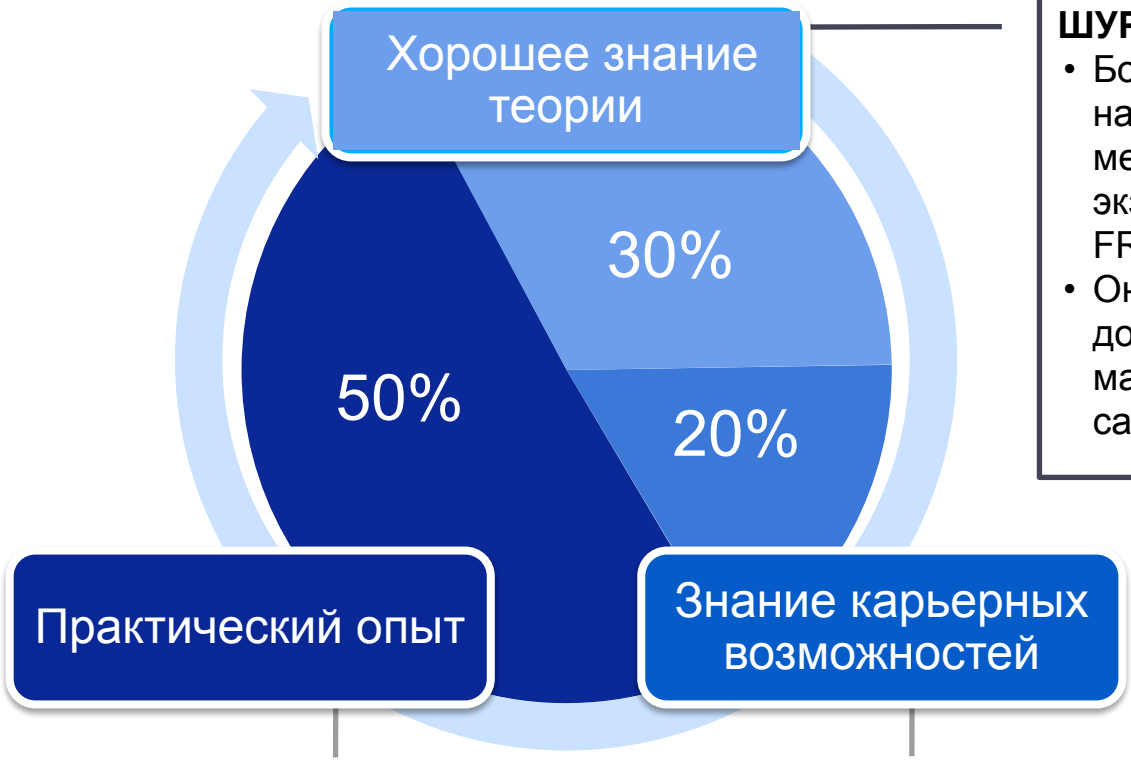
Первый этап отбора в функциональное подразделение Риски ВТБ

- Цель программы – подготовить современных риск-аналитиков

- То есть людей, которые могут
  - Эффективно обрабатывать информацию
  - Строить модели
  - Понятно доносить результаты своей работы

- Профильные направления деятельности выпускников программы
  - кредитный анализ
  - количественный риск-менеджмент

Чтобы стать риск-менеджером, необходимо:



ШУР ВТБ – это:
- Более 400 знаний и навыков из международных экзаменов CFA и FRM
- Онлайн-курсы и дополнительные материалы для самоподготовки

ШУР ВТБ – это:
- Практический бизнес кейс с использованием методов машинного обучения и финансового анализа
- Занятия по машинному обучению

ШУР ВТБ – это:
- Мастер-классы от сотрудников ВТБ
- Предложение о работе лучшим выпускникам

Специализации и направления

Финансы

Микроэкономика, финансовый анализ, корпоративные финансы,
анализ отрасли и стоимость компании

Риск-менеджмент

Финансовые инструменты, анализ рисков, управление рисками

Проект

Кредитный анализ: финансы в Excel и машинное обучение на Python

Количественное моделирование

эконометрика, финансовая математика, машинное обучение, Python

«Финансы»: основные компетенции

- Микроэкономика: анализировать спрос и предложение, анализировать структуру рынка
- Финансовый анализ: анализировать финансовую отчетность (по МСФО и РСБУ), оценивать кредитоспособность предприятий
- Корпоративные финансы: оценивать инвестиционную привлекательность проектов, использовать финансовый рычаг, управлять оборотным капиталом
- Инвестиционный анализ: анализировать отрасль и стоимость компании

«Риск-менеджмент»: основные компетенции

- Финансовые инструменты: оценивать стоимость ценных бумаг и производных финансовых инструментов
- Анализ рисков: измерять риски инвестиционного портфеля и использовать инструменты хеджирования, моделировать VaR и ES
- Управление рисками: использовать опыт финансовых кризисов и катастроф, использовать интегрированный подход к риск-менеджменту в организации

«Количественное моделирование»: основные компетенции

- Эконометрика: исследовать зависимости и строить прогнозы, моделировать тренд и волатильность, оценивать квантили и экстремальные значения, строить многомерные модели с использованием копул
- Финансовая математика: оценивать стоимость опционов с помощью биномиальных деревьев и модели Блэка-Шоулза, рассчитывать “греки” опционных стратегий
- Машинное обучение: использовать модели обучения с учителем и без учителя, строить ансамбли моделей, моделировать фичи, использовать нейронные сети

Проект: основные компетенции

- моделировать вероятность возврата кредита
- оценивать вероятность дефолта
- строить финансовые модели в Excel
- строить классификационные модели на Python

Детали отбора и обучения

- Продолжительность обучения: октябрь-декабрь 2019 года.
- Место проведения:

  Самарский национальный исследовательский университет имени академика С.П. Королева
- Целевая аудитория: студенты и выпускники с хорошей математической и / или программистской подготовкой.
- Критерии отбора:

  - экзамен по теории вероятностей,

  - учебные, научные и профессиональные достижения.
- Плановый набор на программу: 150 человек.

Преимущества программы

- CFA и FRM (более 400 learning outcomes)
- Преподаватели - практики
- Лучшие выпускники программы - получат предложение о работе в Банке ВТБ
- Занятия на программе - бесплатные

РЕГИСТРАЦИЯ НА ПРОГРАММУ:

ВТБ