



# ME2070 Riskhantering i bank- och försäkring 7,5 hp

Enterprise Risk Management in Financial Industry

När kurs inte längre ges har student möjlighet att examineras under ytterligare två läsår.

## Fastställande

Kursplan för ME2070 gäller från och med VT12

## Betygsskala

A, B, C, D, E, FX, F

## Utbildningsnivå

Avancerad nivå

## Huvudområden

Industriell ekonomi

## Särskild behörighet

SF2974 Portfolio theory and Risk Management and SF2980 Risk Management or equivalent.

## Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

# Lärandemål

Målet med kursen är att ge praktiska kunskaper om riskhantering i banker och försäkringsbolag. Riskhanteringen ses som ett samspel mellan tillämpning av matematiska modeller och mjuka faktorer såsom riskkultur, administrativa processer, kontroller, monitorering mm. Detta i en värld som är strikt styrd av regelverk såsom Basel III och Solvency II, styrelsens och ägarnas krav mm. Efter avklarad kurs ska du kunna:

1. Förstå och beskriva vad företagsövergripande riskhantering innebär i allmänhet och inom de individuella riskområdena marknadsrisk, kreditrisk, likviditetsrisk och operativ risk.
2. Förstå grunderna för och syften med regelverken Basel II & ”III” samt Solvency II och effekterna av dessa regelverk.
3. Applicera de teoretiska koncepten i fallstudier

# Kursinnehåll

## Examination

- SEM1 - Seminarier, 3,5 hp, betygsskala: P, F
- TEN1 - Tentamen, 4,0 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, F

Examinator beslutar, baserat på rekommendation från KTH:s handläggare av stöd till studenter med funktionsnedsättning, om eventuell anpassad examination för studenter med dokumenterad, varaktig funktionsnedsättning.

Examinator får medge annan examinationsform vid omexamination av enstaka studenter.

## Etiskt förhållningssätt

- Vid grupparbete har alla i gruppen ansvar för gruppens arbete.
- Vid examination ska varje student ärligt redovisa hjälp som erhållits och källor som använts.
- Vid muntlig examination ska varje student kunna redogöra för hela uppgiften och hela lösningen.