

LƯU Ý TỪ GIẢNG VIÊN CHO **FRM2-CREDIT RISK** (VUI LÒNG ĐỌC TRƯỚC KHI HỌC)

Môn này có 3 trọng điểm:

1. Rủi ro tín dụng (mô hình đo lường rủi ro tín dụng như là các phương pháp đo lường PD, rủi ro tín dụng danh mục) Phần này có nhiều công thức phức tạp cần làm kỹ các bài tập trong schweser để biết cách tính toán, nhất là phần PD theo merton model, portfolio credit var và single factor model.
2. Rủi ro tín dụng đối tác (định nghĩa, đo lường, giảm thiểu). Phần này thiên về lý thuyết, ít tính toán nhưng có nhiều vấn đề đan xen giữa thị trường và tín dụng (nôm na là rủi ro phát sinh từ cả thị trường và tín dụng). Lý thuyết là nhiều nên chú trọng đọc mindmap và nên viết thêm nhiều ý cần nhớ vào mindmap để đọc lại
3. Sản phẩm phái sinh tín dụng và sản phẩm cấu trúc. Cần lưu ý học và hiểu cơ chế sản phẩm là quan trọng nhất, và từ đó biết cách định giá các sản phẩm cơ bản như CDS, lãi lỗ của các tranche CDO. Đồng thời nắm được rủi ro của sản phẩm

NỘI DUNG CÁC VIDEOS (36 videos)

Video	Nội dung	Thời lượng
CR.01	Fundamentals of Credit Risk	24m
CR.02	Governance	42m
CR.03.1	Credit Risk Management	34m
CR.03.2		37m
CR.03.3		21m
CR.03.4		32m
CR.04	Capital structure in Bank	41m
CR.05.1	Introduction to Credit risk modeling and Assessment	36m
CR.05.2		28m
CR.06	Credit Scoring and Rating	1h15m
CR.07	Credit Scoring and Retail Credit Risk Management	53m
CR.08	Sovereign Default Risk	1h37m
CR.09.1	Estimating Default Probabilities	1h09m
CR.09.2		33m
CR.09.3		52m
CR.09.4		36m
CR.09.5		59m

CR10.1	Credit Value at Risk	59m
CR10.2		53m
CR10.3		31m
CR11	Portfolio Credit Risk	1h52m
CR12.1	Credit Risk	47m
CR12.2		31m
CR13.1	Credit Derivatives	1h15m
CR13.2		40m
CR13.3		1h23m
CR.14	Derivatives	1h30m
CR.15	Counterparty Risk and Beyond	1h12m
CR.16	Netting, Close-Out, and Related Aspects	1h25m
CR.17	Margin (Collateral) and Settlement	1h12m
CR.18	Central clearing	1h39m
CR.19	Future Value and Exposure	1h11m
CR.20	Credit Value Adjustment	58m
CR20.2	Wrong Way Risk	34m
CR.21	The Evolution of Stress Testing Counterparty Exposures	58m
CR.22	Structure Credit Risk	2h12m
CR.23	An Introduction to Securitization	1h50m