

Nazwa przedmiotu:	Teoria i modele zarządzania ryzykiem			
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: 7 Rok: IV	Forma zaliczenia: egzamin	ECTS 7	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Bankowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie		
Specjalność: AFi ZR				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
prof. dr hab.	Pracownicy Katedry IFiZR	zi_ifizr@ue.wroc.pl	3680338	307 Z

1. Wymagania wstępne

Zaliczone przedmioty: statystyka, ekonometria, analiza i zarządzanie portfelem, rynki i instrumenty finansowe

2. Program przedmiotu

1. Wprowadzenie do zarządzania ryzykiem – pojęcia, historia, rodzaje.
2. Proces zarządzania ryzykiem.
3. Teoria ryzyka.
4. Pomiar ryzyka rynkowego (w podziale na: ryzyko stopy procentowej, ryzyko kursu walutowego, ryzyko cen akcji, ryzyko cen towarów).
5. Modelowanie stopy procentowej.
6. Modelowanie kursu walutowego.
7. Sterowanie ryzykiem rynkowym – strategię.
8. Pomiar ryzyka kredytowego.
9. Modelowanie ryzyka kredytowego.
10. Sterowanie ryzykiem kredytowym (w tym kredytowe instrumenty pochodne).
11. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym.
12. Ryzyko cen nieruchomości i instrumenty pochodne rynku nieruchomości.
13. Ryzyko pogodowe i inne.
14. Zarządzanie ryzykiem bankowym.
15. Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwie.
16. Standardy w zakresie zarządzania ryzykiem.
17. Przypadki błędów w zarządzaniu ryzykiem.

3. Metodyka zajęć

wykład

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: rodzaje ryzyka, proces zarządzania ryzykiem, ogólne tendencje w zarządzaniu ryzykiem, rodzaje miar ryzyka, główne miary ryzyka, modele wykorzystywane do szacowania ryzyka rynkowego i kredytowego, ogólna charakterystyka systemu zarządzania ryzykiem; umiejętności: wybór metody (miary i modelu) szacowania ryzyka, zabezpieczanie pozycji z wykorzystaniem instrumentów pochodnych

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. K. Jajuga: Zarządzanie ryzykiem. PWN 2007.
2. Z. Krysiak: Ryzyko kredytowe a wartość firmy.
3. P. Matkowski: Zarządzanie ryzykiem operacyjnym. Wolters Kluwer Polska - Oficyna 2006

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

1. Ph. Best: Wartość narażona na ryzyko: obliczanie i wdrażanie modelu VAR. Oficyna Ekonomiczna, 2000
2. Cormac Butler: Tajniki Value at Risk: praktyczny podręcznik zastosowań metody VaR. K.E.Liber, 2001
3. K. Jajuga: Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe,...PWN 2007
4. J. Hull: Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie. WIG-Pres 1998