Nazwa przedmiotu:	**ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W BANKU**		
Forma: Ćwiczenia	Godzin: 30 Semestr: 8 Rok: 4	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Bankowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie	
Specjalność: AFiZR			

Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Ewa Kania	ewa.kania@ue.wroc.pl	80353	411 Z

1.Wymagania wstępne

Matematyka finansowa, bankowość

2. Program przedmiotu

1. Szacowanie poziomu ryzyka płynności
2. Reguły zabezpieczania i metody zarządzania ryzykiem płynności
3. Analiza luki płynności (kontraktowej i urealnionej)
4. Podstawowe miary ryzyka kredytowego w nowej umowie kapitałowej
5. Analiza wiarygodności kredytowej klientów indywidualnych i korporacyjnych
6. Rola ratingów zewnętrznych i wewnętrznych w zarządzaniu ryzykiem kredytowym
7. Kategorie zdarzeń i obszarów działalności banku generujących ryzyko operacyjne
8. Metody wyznaczania wymogów kapitałowych na ryzyko operacyjne
9. Rekomendacje nadzorcze odnośnie do ryzyka operacyjnego
10. Kwantyfikacja i sterowanie ryzykiem stopy procentowej. Luka terminów płatności
11. Duration i wypukłość aktywów generujących ryzyko stopy procentowej
12. Micro- i macrohedging w zarządzaniu ryzykiem stopy procentowej
13. Pomiar ryzyka walutowego i limity pozycji walutowych
14. Ryzyko walutowe - instrumenty i operacje rynku walutowego

3. Metodyka zajęć

Rozwiązywanie zadań w arkuszu Excel; case studies

4.Cel dydaktyczny przedmiotu

Zapoznanie studentów z teorią i praktyką zarządzania ryzykiem w banku

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. K. Jajuga (red.), Zarządzanie ryzykiem, PWN Warszawa 2007

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

1. D. Gątarek i in., Nowoczesne metody zarządzania ryzykiem finansowym, WIG-Press Warszawa 2001
2. A. Saunders, Metody pomiaru ryzyka kredytpowego, Oficyna Ekonomiczna Kraków 2001