

Nazwa przedmiotu:	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W BANKU			
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: 8 Rok: 4	Forma zaliczenie: egzamin	ECTS 7	
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

- Pojęcie i rodzaje ryzyka bankowego. Przyczyny wzrostu ryzyka
- Etapy zarządzania ryzykiem bankowym
- Ryzyko stopy procentowej. Zarządzanie ryzykiem luki funduszowej
- Analiza czynników wpływających na dochód banku
- Zarządzanie luką duration. Analiza duration w banku komercyjnym
- Transakcje zabezpieczające bank przed ryzykiem stopy procentowej
- Ryzyko walutowe. Instytucjonalne formy zabezpieczenia ryzyka walutowego
- Transakcje zabezpieczające bank przed ryzykiem walutowym
- Ryzyko płynności i jego przyczyny. Zarządzanie ryzykiem płynności
- Płynność i rentowność banku. Teoretyczne koncepcje regulowania płynności.
- Metody zarządzania ryzykiem płynności. Rola funduszy własnych
- Ryzyko kredytowe, pojęcia, klasyfikacja. Czynniki ryzyka kredytowego
- Ocena zdolności kredytowej. Monitoring kredytowy. Rezerwy celowe
- Ryzyko operacyjne w nowej umowie kapitałowej.

3. Metodyka zajęć

Wykład z wykorzystaniem prezentacji MS PowerPoint

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Zapoznanie studentów ze specyfiką ryzyka bankowego i metodami jego ograniczania

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

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

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

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