

Nazwa przedmiotu:	Zarządzanie ryzykiem w zakładzie ubezpieczeń			
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: 8 Rok: IV	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 6	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Bankowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie		
Specjalność: Analityk finansowy i zarządzanie ryzykiem				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
prof. dr hab.	Wanda Ronka-Chmielowiec	wanda.ronka-chmielowiec@ue.wroc.pl	3680352	306/Z

1. Wymagania wstępne

Ubezpieczenia, rynek finansowy, statystyka

2. Program przedmiotu

ryzyko w działalności ubezpieczeniowej, klasyfikacja ryzyka występującego w działalności ubezpieczeniowej, ryzyko ubezpieczeniowe, ryzyko kredytowe, ryzyko operacyjne, ryzyko rynkowe, przegląd metod zarządzania ryzykiem zakładu ubezpieczeń, wymagania ustawowe: model marginesu wypłacalności, założenia Solvency II, zadania i wymagania organu nadzoru, ilościowe metody pomiaru ryzyka występującego w działalności ubezpieczeniowej: miary kwantylowe i podejście aktuarialne (elementy teorii ruiny)

3. Metodyka zajęć

prezentacja tematyki na wykładzie

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: poznanie metod postępowania z ryzykiem występującym w działalności ubezpieczeniowej,

umiejętności: identyfikacja ryzyka zakładu ubezpieczeń, umiejętność pomiaru poszczególnych kategorii ryzyka, podejmowanie decyzji w zakresie wyboru metody zarządzania poszczególnymi kategoriami ryzyka

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. K.Jajuga (red.) Zarządzanie ryzykiem, PWN, Warszawa 2007,
2. P.Kowalczyk, E.Poprawska, W.Ronka-Chmielowiec, Metody aktuarialne, PWN, warszawa 2006,
3. W.Ronka-Chmielowiec (red.) zarządzanie finansami w zakładzie ubezpieczeń, Oficyna Branta, Bydgoszcz 2002

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

1. W. Ronka-Chmielowiec, Modelowanie ryzyka w ubezpieczeniach, wyd. AE Wrocław, 2002,
2. J. Monkiewicz (red.), Podstawy ubezpieczeń tom III, Poltext, Warszawa 2002,
3. strony internetowe PIU i KNF