

Nazwa przedmiotu:	<b>Zarządzanie ryzykiem</b>			
Forma: Wykład	Godzin: 8;10 Semestr: 5 i 6 Rok: III	Forma zaliczenie: egz.w przyszłym sem.	ECTS 1;2	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Rachunkowość	Tryb: stacjonarny	Rodzaj: licencjackie	
Specjalność: RiP, RiA, RF, ZF				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Paweł Rokita	pawel.rokita@ue.wroc.pl	3680401	708-Z

### 1. Wymagania wstępne

Statystyka, ekonometria, matematyka finansowa, instrumenty finansowe

### 2. Program przedmiotu

1. Wprowadzenie – definicja ryzyka, proces zarządzania ryzykiem, ogólne tendencje w zarządzaniu ryzykiem.
2. Podejmowanie decyzji w warunkach ryzyka.
3. Miary ryzyka rynkowego.
4. Miara Value at Risk i sposoby jej szacowania.
5. Pomiar ryzyka rynkowego – ogólne procedury.
6. Zarządzanie ryzykiem rynkowym – ogólne procedury.
7. Zarządzanie ryzykiem cen akcji.
8. Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego.
9. Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej.
10. Pomiar i zarządzanie ryzykiem przedsiębiorstw – Cash Flow at Risk.
11. Elementy pomiaru ryzyka kredytowego.
12. Elementy zarządzania ryzykiem kredytowym.
13. Ryzyko operacyjne i metody zarządzania nim.
14. Ryzyko pogodowe i ryzyko katastrof. 15. Katastrofy finansowe i wnioski.

### 3. Metodyka zajęć

Wykład

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: modele stosowane w pomiarze i prognozowaniu ryzyka rynkowego, zalety, wady i zastosowania podejść opartych na modelach statystyczno-ekonometrycznych oraz metod wykorzystujących analizę scenariuszy, zasady wyznaczania wymogu kapitałowego, modele stosowane w pomiarze ryzyka kredytowego, modele stosowane w pomiarze ryzyka operacyjnego; umiejętności: wybór metody (miary i modelu) szacowania ryzyka, pomiar ryzyka rynkowego

#### 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