



Przedmiot: Zarządzanie ryzykiem finansowym				
Forma zajęć: ćwiczenia	Semestr: 8	Rok: 4	Wymiar godzin: 15	Punkty ECTS: 3
Forma zaliczenia: egzamin	Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski	
Kierunek: Finanse i Rachunkowość		Tryb: niestacjonarne wieczorowe		Rodzaj: jednolite magisterskie
Specjalność: iWszystkie na kierunku				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Urszula Mleczkoi		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Podstawy finansów, bankowość, ubezpieczenia, matematyka finansowa

Program przedmiotu:

1. Procedury udzielania kredytu i badanie zdolności kredytowej. Metody pomiaru ryzyka kredytowego
2. Metody pomiaru ryzyka kredytowego dla portfela kredytowego
3. Metody pomiaru ryzyka stopy procentowej
4. Identyfikacja i pomiar ryzyka walutowego i instrumenty zabezpieczające
5. Metody i strategie zarządzania ryzykiem płynności
6. Zależność pomiędzy ryzykiem a dochodem
7. Zależność pomiędzy ryzykiem a funduszami własnymi

Metody dydaktyczne:

Metody aktywizujące: metoda analizy przypadków
Metody praktyczne: rozwiązywanie zadań

Cele przedmiotu:

Wyrobienie umiejętności analizowania problemów i zdarzeń w obszarze zarządzania ryzykiem. Wyrobienie umiejętności rozwiązywania problemów. Wyrobienie umiejętności związanych z wyborem metod pomiaru ryzyka kredytowego, płynności, stopy procentowej i walutowego. I Wykształcenie umiejętności polegających na ocenie wpływu ryzyka na wynik finansowy i fundusze własne przedsiębiorstwa

Warunki zaliczenia:

1. Obowiązkowe uczestnictwo w zajęciach. Dopuszcza się 2 nieobecności. Przy czym każda musi zostać odrobiona u prowadzącego ćwiczenia.
2. Aktywny udział w zajęciach
3. Dwa kolokwia zaliczeniowe w formie zadań do rozwiązania

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. A. Souders, Metody pomiaru ryzyka kredytowego, Oficyna Ekonomiczna Dom Wydawniczy ABC, 2001
2. A. Janc, M. Kraska, Credit-scoring. Nowoczesna metoda oceny zdolności kredytowej, Biblioteka Menadżera i Bankowca, 2001
3. Niedziółka P., Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w banku, Difin, Warszawa, 2002
4. M. Wójciak, Metody oceny ryzyka kredytowego, PWE, Warszawa, 2007

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Bankowość. Podręcznik akademicki, pod red. W. Jaworskiego, Z. Zawadzkiej, Poltex, 2001
2. D. Misińska, M. Niewidoma, Rachunkowość bankowa, Wydawnictwo AE, Wrocław, 2003
3. M. Iwanicz-Drozdowska, Zarządzanie finansowe bankiem, PWE, Warszawa, 2005
4. Bennett D., Ryzyko walutowe, Dom wydawniczy ABC, Kraków, 2000,