



Przedmiot: Zarządzanie ryzykiem finansowym				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 8	Rok: 4	Wymiar godzin: 15	Punkty ECTS: 5
Forma zaliczenia: egzamin	Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski	
Kierunek: Finanse i Rachunkowość		Tryb: niestacjonarne wieczorowe		Rodzaj: jednolite magisterskie
Specjalność: FIRSP				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Urszula Mleczko		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Podstawy finansów, bankowość, ubezpieczenia, matematyka finansowa

Program przedmiotu:

1. Zarządzanie przedsiębiorstwem, a problem ryzyka.
2. Czynniki makro i mikroekonomiczne mające wpływ na ryzyko.
3. Rodzaje ryzyka w działalności banku
4. Ryzyka kredytowe i czynniki mające na nie wpływ
5. Indywidualne ryzyko kredytowe. Ryzyko kredytowe dla portfela kredytowego.
7. Ryzyko rynkowe – ryzyko stopy procentowej i ryzyko walutowe
8. Ryzyko płynności i wynikające z niego zagrożenia dla działalności przedsiębiorstwa
9. Ryzyko operacyjne
- 10.6. Zarządzanie ryzykiem w świetle Nowa Umowa Kapitałowa (NUK)
11. System zarządzania ryzykiem i system kontroli wewnętrznej jako elementy systemu zarządzania
12. Wpływ ryzyka na osiągnięty wynik finansowy i kapitały

Metody dydaktyczne:

Metoda podająca, wykład informacyjny, z wykorzystaniem techniki audiowizualnej (folie - rzutnik pisma, slajdy - projektor multimedialny).

Cele przedmiotu:

Przedstawienie i zrozumienie istoty ryzyka w działalności przedsiębiorstwa. Przedstawienie zagadnień związanych z zarządzaniem ryzykiem finansowym w działalności banku. Przekazanie wiedzy na temat sposobów ograniczania ryzyka w działalności podmiotu gospodarczego

Warunki zaliczenia:

Egzamin pisemny w formie otwartych pytań

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. J.K. Solarz, Zarządzanie ryzykiem systemu finansowego, PWN, Warszawa, 2008
2. Zarządzanie ryzykiem, pod.red. K.Jajuga, Wyd. PWN, Warszawa, 2007
3. M. Wójciak, Metody oceny ryzyka kredytowego, PWE, Warszawa, 2007
4. M.Iwanicz-Drozdowska, Zarządzanie finansowe bankiem, PWE, Warszawa, 2005

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Bankowość. Podręcznik akademicki, pod red. W.Jaworskiego, Z.Zawadzkiej, Poltex, 2001
2. D.G Uyemura, D.R.Van Deventer, Zarządzanie ryzykiem finansowym w bankach, ZBP, Warszawa, 1997
3. G. Rogowski, Metody analizy i oceny działalności banku na potrzeby zarządzania strategicznego, Wyd. WSB, Poznań, 1998