



Przedmiot: Zarządzanie Ryzykiem Finansowym				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 8	Rok: 4	Wymiar godzin: 30	Punkty ECTS:
Forma zaliczenia: egzamin	Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski	
Kierunek: Finanse i Bankowość		Tryb: stacjonarne		Rodzaj: jednolite magisterskie
Specjalność: FIRS				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Michał Muszyński		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Rynek kapitałowy, Zarządzanie finansami przedsiębiorstw

Program przedmiotu:

1. Pojęcie i klasyfikacja ryzyka.
2. Proces zarządzania ryzykiem – sposoby ograniczania ryzyka. (przyczyny wielkich bankructw)
3. Tradycyjne miary ryzyka.
4. Nowoczesne miary ryzyka.
5. Ograniczanie ryzyka – teoria portfela.
6. Proces budowy portfela inwestycji – postawy względem ryzyka.
7. Ryzyko stopy procentowej – analiza duracji i luki odsetkowej.
8. Zabezpieczanie ryzyka rynkowego – instrumenty, strategie.
9. Stosowanie zasad rachunkowości zabezpieczeń.
10. Ocena ryzyka kredytowego.
11. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym.

Metody dydaktyczne:

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

Cele przedmiotu:

Kurs pozwala na zapoznanie studentów z pojęciem ryzyka finansowego i jego rolą w podejmowaniu decyzji.

Warunki zaliczenia:

Egzamin

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

K. Jajuga: "Zarządzanie ryzykiem finansowym", PWN, Warszawa 2007
M. Zaleska: „Współczesna bankowość”, Diffin, Warszawa 2007

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):