



# SGH

Informator	2018/2019
Tytuł oferty	Zarządzanie ryzykiem w bankach
Sygnatura	236100 - 0951 <span style="float: right;">3 pkt. ECTS</span>
Prowadzący	dr Agnieszka Krystyna Nowak oraz zespół: dr Ewa Cichowicz

## A. Cel przedmiotu

Celem zajęć jest zapoznanie studentów z podstawowymi rodzajami ryzyka towarzyszącego działalności banków, mechanizmami ich monitorowania i ograniczania.

## B. Program przedmiotu

1. Istota i rodzaje ryzyka w banku. 2. Charakterystyka, analiza, proces i metody zarządzania ryzykiem. 3. Ryzyko w bankach a regulacje nadzorcze. 4. Adekwatność kapitałowa. 5. Zastosowanie instrumentów pochodnych do ograniczania ryzyka w bankach.

## C. Szczegółowe przedmiotowe efekty kształcenia

Wiedza	<ol style="list-style-type: none"><li>1. Student powinien definiować i rozpoznawać podstawowe rodzaje ryzyka w działalności banków.</li><li>2. Student powinien posiadać wiedzę w zakresie podstawowych metod monitorowania ryzyka w bankach.</li><li>3. Student powinien rozumieć mechanizmy ograniczania ryzyka bankowego.</li></ol>
Umiejętności	Umiejętność praktycznego zbudowania narzędzi i metod monitorowania poszczególnych rodzajów ryzyka w banku. Umiejętność praktycznego zastosowania narzędzi i metod monitorowania poszczególnych rodzajów ryzyka w banku. ...
Kompetencje społeczne	Praca w grupie. Udział w dyskusji.

#### D. Semestralny plan zajęć

- 1 - Istota i rodzaje ryzyk w banku. Proces i metody zarządzania ryzykiem bankowym
- 2 - Ryzyko rynkowe: metody pomiaru i uwarunkowania prawne
- 3 - Ryzyko rynkowe: zarządzanie ryzykiem
- 4 - Ryzyko kredytowe: metody pomiaru i uwarunkowania prawne
- 5 - Ryzyko kredytowe: zarządzanie ryzykiem
- 6 - Ryzyko stopy procentowej: metody pomiaru i uwarunkowania prawne
- 7 - Ryzyko stopy procentowej: zarządzanie ryzykiem
- 8 - Ryzyko płynności: metody pomiaru i uwarunkowania prawne
- 9 - Ryzyko płynności: zarządzanie ryzykiem
- 10 - Ryzyko operacyjne: metody pomiaru i uwarunkowania prawne
- 11 - Ryzyko operacyjne: zarządzanie ryzykiem
- 12 - Inne rodzaje ryzyka (niekwantyfikowane). Nadzorcze normy ostrożnościowe.
- 13 - Zastosowanie instrumentów pochodnych w ograniczaniu ryzyka w bankach
- 14 - Adekwatność kapitałowa i zarządzanie ryzykiem kapitałowym
- 15 - Podsumowanie. Nadzorcze normy ostrożnościowe

#### E. Literatura podstawowa (obowiązkowe podręczniki)

Zarządzanie ryzykiem bankowym, M. Iwanicz-Drozdowska (red. nauk.), Poltext, Warszawa 2017

#### F. Literatura uzupełniająca

Ryzyko instytucji finansowych. Współczesne trendy i wyzwania, T. Czerwińska, K. Jajuga (red. nauk.), CH Bek, Warszawa 2016

#### G. Najważniejsze publikacje autora(ów) dotyczące proponowanych zajęć

(1) Ryzyko struktury bilansu, [w:] Zarządzanie ryzykiem bankowym, M. Iwanicz-Drozdowska (red. nauk.), Poltext, Warszawa 2017 (2) Zarządzanie ryzykiem operacyjnym w wybranych bankach w Polsce (współautor: E. Cichowicz), Gospodarka Narodowa nr 1 (275)/2015, styczeń / luty 2015, str. 103-128 (3) Zarządzanie ryzykiem płynności w bankach działających w Polsce w dobie globalnego kryzysu finansowego, Problemy Zarządzania Nr 2/2013 (42), Zarządzanie ryzykiem i ubezpieczenia, pismo Wydziału Zarządzania UW, JEL Classification G21, 2013

#### H. Sygnatury wymaganych prekwizytów

nie są wymagane

#### I. Wymiar i forma zajęć

	Stacj.	Sb.Niedz.	Popołud.
<b>Ogółem:</b>	30	14	30
Wykład	30	14	30

**J. Elementy oceny końcowej**

egzamin testowy	80%
referaty/eseje	20%

**K. Wymagana znajomość języka obcego**

nie jest wymagana

**L. Kryteria selekcji****M. Metody prowadzenia zajęć**

kejsy(Analiza metod monitorowania ryzyka w wybranych bankach)  
dyskusje(Ocena zasad monitorowania ryzyka w wybranych bankach)  
udział praktyków(Wykład praktyków na zaproszenie)