

Nazwa przedmiotu:	MODELE I STRATEGIE ZARZĄDZANIA RYZYKIEM			
Forma: Wykład	Godzin: 24 Semestr: 3 Rok: II	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 2	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Rachunkowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: II stopień		
Specjalność: Analityk finansowy i zarządzanie ryzykiem				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
	KIFiZR	zi_ifizr@ue.wroc.pl	3680-338	307Z

1. Wymagania wstępne

Statystyka, ekonometria, matematyka finansowa, analiza instrumentów finansowych

2. Program przedmiotu

1. Wprowadzenie - definicja ryzyka, rodzaje ryzyka, proces zarządzania ryzykiem, ogólne tendencje w zarządzaniu ryzykiem.
2. Podejmowania 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. Elementy zarządzania ryzykiem cen towarów.
11. Pomiar ryzyka kredytowego.
12. Zarządzanie ryzykiem kredytowym.
13. Ryzyko operacyjne i metody zarządzania nim.
14. Ryzyko katastrof i metody zarządzania nim. 15. Ryzyko pogodowe i metody zarządzania nim. 16. Katastrofy finansowe i wnioski

3. Metodyka zajęć

Wykład

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiadomości: rodzaje ryzyka, proces zarządzania ryzykiem, ogólne tendencje w zarządzaniu ryzykiem, rodzaje miar ryzyka, główne miary ryzyka, modele wykorzystywane do szacowania ryzyka rynkowego i kredytowego, ogólna charakterystyka systemu zarządzania ryzykiem; umiejętności: wybór metody (miary i modelu) szacowania ryzyka, zabezpieczanie pozycji z wykorzystaniem instrumentów pochodnych

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