|  |  |
| --- | --- |
|  | KARTA PRZEDMIOTU – UNIWERSYTET EKONOMICZNY W KRAKOWIE |
|  |  |

Kierunek: Finanse i rachunkowość

|  |  |
| --- | --- |
| Nazwa przedmiotu | **Zarządzanie ryzykiem finansowym** |
| Język prowadzenia przedmiotu | polski |
| Kod/Specjalność | Zarządzanie bankiem |
| Kategoria przedmiotu | Specjalnościowe |
| Profil studiów | Ogólnoakademicki |
| Poziom PRK | Poziom 7 - 2. stopień (studia magisterskie) |
| Rok studiów/semestr | 2/1 |
| Forma zajęć/liczba godzin |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Wykłady  | Ćwiczenia |
| Stacjonarne: | - | - |
| Niestacjonarne: |  9 |  9 |

 |
| Dyscypliny |

|  |  |
| --- | --- |
| Nazwa | Liczba punktów ECTS |
| Ekonomia i finanse |  4 |
|  |  |

 |
| Wykładowca odpowiedzialny za przedmiot na kierunku | Dr Krzysztof Kil |
| Cele przedmiotu |

|  |  |
| --- | --- |
| Kod | Opis |
| C1 | Zaznajomienie studentów z procesem zarządzania poszczególnymi kategoriami ryzyka finansowego w działalności bankowej, zgodnie z obowiązującymi regulacjami Bazylejskiego Komitetu Nadzoru Bankowego, pakietu CRD IV/CRR, regulacji krajowych |
| C2 | Wykształcenie umiejętności studentów w zakresie kalkulacji ekspozycji banku na podstawowe kategorie ryzyka oraz wyznaczania wymogu kapitałowego dla instytucji kredytowych |

 |
| Realizowane efekty uczenia się  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Kod | Kat. | Opis  | Odniesienie do efektów kierunkowych |
| E1 | W | Student ma pogłębioną wiedzę dotyczącą zarządzania instytucjami finansowymi i ryzyka związanego z ich działalnością | WF-ST2-FR-W05-19/20Z |
| E2 | U | Student potrafi identyfikować, mierzyć i oceniać poziom ryzyka finansowego, kompetentnie zaproponować różne rozwiązania i poddać je krytyce. | WF-ST2-FR-U05-19/20Z |
| E3 | K | Student jest gotów do rozwiązywania problemów praktycznych z zakresu zdobytej wiedzy z obszaru zarządzania ryzykiem finansowym, w tym do korzystania z opinii ekspertów w przypadku trudności z samodzielnym rozwiązaniem problemów | WF-ST2-FR-K02-19/20Z |

 |
| Sposoby weryfikacji efektów uczenia się | egzamin pisemny, projekt zespołowy |
| Treści przedmiotu |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Kod | Opis | Liczba godzin stacjonarne | Liczba godzin niestacjonarne |
| W1 | Wprowadzenie do problematyki zarządzania ryzykiem finansowym. Charakterystyka podstawowych pojęć. Typologia ryzyka w działalności bankowej. | - | 3 |
| W2 | Etapy procesu zarządzania ryzykiem finansowym w działalności bankowej. Ryzyko kredytowe – zagadnienia dotyczące oceny zdolności i wiarygodności kredytowej, problematyka rezerw celowych w instytucjach kredytowych. | - | 3 |
| W3 | Zarządzanie ryzykiem rynkowym, operacyjnym i pozostałymi wybranymi kategoriami ryzyka w działalności bankowej | - | 3 |
| C1 | Metody pomiaru ryzyka kredytowego (ekspozycji na ryzyko) i kalkulacji wymogu kapitałowego dla tego ryzyka | - | 3 |
| C2 | Metody pomiaru ryzyka rynkowego (ekspozycji na ryzyko) i kalkulacji wymogu kapitałowego dla tego ryzyka | - | 3 |
| C3 | Metody pomiaru ryzyka operacyjnego (ekspozycji na ryzyko) i kalkulacji wymogu kapitałowego dla tego ryzyka | - | 3 |

 |
| Metody prowadzenia zajęć | wykład audytoryjny, ćwiczenia przedmiotowe, konwersatorium, dyskusja, analiza przypadku, praca z tekstem, nauczanie problemowe |
| Nakład pracy studenta (liczba godzin kontaktowych, pracy on-line i pracy samodzielnej) |

|  |  |
| --- | --- |
| Rodzaj aktywności | Liczba godzin |
| stacjonarne | niestacjonarne |
| Udział w zajęciach dydaktycznych w bezpośrednim kontakcie z prowadzącym | - | 18 |
| Udział w konsultacjach | - | 12 |
| Udział w kolokwiach/egzaminie | - | 5 |
| Praca własna studenta | - | 65 |
| E-learning | - | - |
| Inne | - | - |
| Suma godzin | - | 100 |
| Liczba punktów ECTS | 4 |

 |
| Macierz realizacji przedmiotu |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Przedmiot. efekt uczenia się | Odniesienie do efektów kierunkowych | Cele przedmiotu | Treściprzedmiotu | Metody/narzędziadydaktyczne | Sposoby weryfikacji efektu |
| E1 | WF-ST2-FR-W05-19/20Z |  C1 | W1, W2, W3 | wykład audytoryjny, dyskusja |  egzamin pisemny |
| E2 | WF-ST2-FR-U05-19/20Z | C2 | C1, C2, C3 | ćwiczenia przedmiotowe, dyskusja, analiza przypadku, praca z tekstem, nauczanie problemowe | prace projektowe, egzamin pisemny |
| E3 | WF-ST2-FR-K02-19/20Z | C2 | C1, C2, C3 | nauczanie problemowe | prace projektowe |

 |
| Literatura podstawowa | Zarządzanie ryzykiem bankowym, M. Iwanicz-Drozdowska (red.), Poltext, Warszawa 2017, wydanie 2.Bankowość: Europejski Certyfikat Bankowca EFCB 3E, M. Klimontowicz (red.), ZBP, Warszawa 2018.Hull J. C., Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2011. |
| Literatura uzupełniająca | Zarządzanie instytucjami kredytowymi, A. Gospodarowicz, A. Nosowski (red.), C. H. Beck, Warszawa 2016, wydanie 2. |
| Forma i warunki zaliczenia przedmiotu | Egzamin pisemny, obejmujący zagadnienia poruszane na wykładzie oraz ćwiczeniach (test połączony z zadaniami studium przypadku). Bieżąca ocena działań w czasie ćwiczeń (analiza przypadku, praca zespołowa)Ocena końcowa według poniższego schematu (w relacji do maksymalnej liczby punktów możliwych do uzyskania z egzaminu i prac projektowych):97%-100% celujący (5,5)90%-96,9%               bardzo dobry (5,0);80%-89,9%             dobry plus (4,5);70%-79,9%               dobry (4,0);60%-69,9%               dostateczny plus (3,5);50%-59,9%               dostateczny (3,0);poniżej 50%     niedostateczny (2,0). |
| Osoby prowadzące przedmiot | Dr Krzysztof Kil |
| Informacje dodatkowe |  |