

Executive MBA PROGRAM  
SYLABUS PRZEDMIOTU DO WYBORU  
Rok akademicki 2018/2019

1.	Nazwa przedmiotu:	<b>Zarządzanie ryzykiem finansowym w praktyce</b>				
2.	Informacja ogólna:	<b>Forma zajęć:</b> <input checked="" type="checkbox"/> Wykład <input type="checkbox"/> Ćwiczenia <input type="checkbox"/> Warsztat	<b>Semestr:</b> 3	<b>Forma zaliczenia:</b> Zaliczenie na ocenę	<b>Punkty ECTS:</b> 3	<b>L. godz. :</b> 16
3.	Osoba oferująca przedmiot:	<b>Tytuł/stopień naukowy:</b> dr <b>Imię:</b> Paweł <b>Nazwisko:</b> Siarka <b>Instytucja:</b> PS Risk Solutions <b>Wydział/Katedra:</b> Risk Management <b>Pokój/Budynek:</b> <b>Nr telefonu:</b> +1 862 267 46 77 <b>E-mail:</b> pawel.siarka@stresstests.eu				
4.	Wymagania wstępne: (Kompetencje, które student powinien posiadać, aby uczestniczyć w zajęciach)	Finanse przedsiębiorstw, podstawy księgowości				
5.	Ogólny opis przedmiotu (w kilku zdaniach):	Wykład jest prowadzony przez eksperta z Wall Street specjalizującego się w rynkach finansowych USA oraz Bliskiego Wschodu. Doświadczenie zdobyte w pracy dla instytucji takich jak: Bank of America, JP Morgan, Citigroup, HSBC, czy Credit Suisse pozwala przedstawić w jasny sposób zasady funkcjonowania międzynarodowego systemu finansowego. W trakcie kursu poruszane są kwestie zarządzania ryzykiem stopy procentowej, ryzykiem walutowym, ryzykiem płynności oraz ryzykiem kredytowym, a także ryzykiem operacyjnym. Uczestnicy kursu poznają techniki metody wykorzystywane przez instytucje finansowe celem zabezpieczenia się na wypadek kolejnego kryzysu finansowego. Kurs jest okraszony licznymi przykładami oraz grami symulacyjnymi.				
6.	Metody nauczania:	Gry symulacyjne, case studies,				
7.	Cele kształcenia dla przedmiotu:	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Zapoznanie się typowymi raportami wykorzystywanymi w procesie zarządzania ryzykiem,</li> <li>2. Zapoznanie się z pojęciami typu strata oczekiwana/strata nieoczekiwana,</li> </ol>				

WYDZIAŁ ZARZĄDZANIA, INFORMATYKI I FINANSÓW  
MAGISTERSKIE STUDIA MENEDŻERSKIE  
EXECUTIVE MBA

		<ol style="list-style-type: none"> <li>3. Zapoznanie się z zasadami funkcjonowania globalnego systemu bankowego w kontekście utrzymywania bezpiecznego poziomu kapitału,</li> <li>4. Zapoznanie się z podstawowymi metodami statystycznymi wykorzystywanymi w procesie zarządzania ryzykiem.</li> </ol>
8.	Efekty kształcenia:	<p><b>Wiedza</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Jak zarządzać ryzykiem płynności,</li> <li>2. Jak zarządzać ryzykiem stopy procentowej,</li> <li>3. Jak zarządzać ryzykiem kredytowym,</li> <li>4. Jak zarządzać ryzykiem operacyjnym oraz walutowym,</li> </ol>
		<p><b>Umiejętności</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Identyfikacja czynników ryzyka,</li> <li>2. Interpretowanie raportów przedstawianych w ramach zarządzania aktywami i pasywami (ALM),</li> <li>3. Interpretowanie wyników testów warunków skrajnych (stress testing),</li> <li>4. Ocena zyskowności inwestycji.</li> </ol>
		<p><b>Kompetencje społeczne</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Zarządzanie procesem oceny ryzyka w ramach struktury organizacyjnej firmy,</li> <li>2. Rozumienie całościowego podejścia do procesu zarządzania ryzykiem,</li> <li>3. Zdolność oceny trendów, kierunków rozwoju metod zarządzania ryzykiem w kontekście działalności nadzorców rynków finansowych,</li> <li>4. Zdolność oceny stabilności rynków finansowych.</li> </ol>
9.	Zasadnicze tematy zajęć:	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Zarządzanie ryzykiem płynności,</li> <li>2. Zarządzanie ryzykiem kredytowym,</li> <li>3. Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej,</li> <li>4. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym,</li> <li>5. Ocena rentowności portfeli kredytowych,</li> <li>6. Analizy warunków skrajnych (stress testing) w świetle regulacji UE oraz USA,</li> <li>7. Ocena jakości modeli statystycznych wykorzystywanych w prognozowaniu,</li> <li>8. Efektywna struktura organizacyjna w procesie zarządzania ryzykiem.</li> </ol>
10.	Weryfikacja efektów: (Wymagania stanowiące o zaliczeniu przedmiotu)	Test/ case study
11.	Literatura:	<p><b>Literatura podstawowa</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Financial Risk Management in Banking: The Theory and Application of Asset and Liability Management, Dennis Uyemura, Donald R. Deventer</li> <li>2. Risk Management and Financial Institutions, 4th Edition, John C. Hull</li> <li>3. Credit Risk Measurement: New Approaches to Value at Risk and Other Paradigms, Anthony Saunders</li> </ol> <p><b>Literatura uzupełniająca</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Corporate Risk Management, Tony Merna,</li> </ol>

---

**WYDZIAŁ ZARZĄDZANIA, INFORMATYKI I FINANSÓW**  
**MAGISTERSKIE STUDIA MENEDŻERSKIE**  
**EXECUTIVE MBA**

		<b>2.</b> Stress-testing the Banking System: Methodologies and Applications 1st Edition, Mario Quagliariello
		<b>3.</b>