

SGH

Informator	2024/2025	
Tytuł oferty	Zarządzanie ryzykiem rynkowym i operacyjnym	
Sygnatura	234150 - 0399	3 pkt. ECTS
Prowadzący	dr hab., prof. SGH Paweł Niedziółka oraz zespół: dr hab., prof. SGH Paweł Kamil Kulpaka, dr Marcin Mateusz Mikołajczyk	

A. Cel przedmiotu

Celem zajęć jest zapoznanie studentów z: 1. czynnikami oraz znaczeniem ryzyka rynkowego i operacyjnego a także jego powiązaniem z innymi rodzajami ryzyka bankowego, 2. procesem zarządzania i metodami pomiaru oraz ograniczania ryzyka rynkowego i operacyjnego, 3. regulacjami nadzorczymi dotyczącymi ryzyka rynkowego i operacyjnego, 4. problemami i ograniczeniami związanymi z wdrażaniem zaawansowanych metod pomiaru ryzyka.

B. Ogólna charakterystyka zajęć (abstrakt)

Ryzyko rynkowe i operacyjne jako komponenty ryzyka bankowego. Wzajemne interakcje między ryzykiem rynkowym i operacyjnym oraz innymi typami ryzyka bankowego. Proces zarządzania oraz pomiaru ryzyka rynkowego i operacyjnego z podziałem na metody standardowe oraz zaawansowane. Uwarunkowania związane z regulacjami nadzorczymi.

C. Przedmiotowe efekty uczenia się

Wiedza	<ol style="list-style-type: none">1. Student przyswaja wiedzę na temat głównych czynników i przyczyn powstawania ryzyka rynkowego i operacyjnego.2. Student posiada wiedzę na temat powiązań ryzyka rynkowego i operacyjnego z innymi rodzajami ryzyka bankowego.3. Student zna metody pomiaru ryzyka rynkowego i operacyjnego.4. Student zna przepisy, normy i regulacje ostrożnościowe w zakresie ryzyka rynkowego i operacyjnego
Umiejętności	<ol style="list-style-type: none">1. Student posiada umiejętności wyciągania wniosków ze zmieniającej się sytuacji banków mającej wpływ na poziom ryzyka rynkowego i operacyjnego.2. Student potrafi przeanalizować sytuację w celu dokonania wyboru właściwej metody oceny i pomiaru ryzyka.3. Student umie na podstawie dostępnych danych określić i zmierzyć poziom ryzyka rynkowego i operacyjnego.4. Studenci odznaczają się umiejętnością jasnego i jednoznacznego przedstawiania (specjalistom oraz odbiorcom spoza grona specjalistów) swoich wniosków oraz wiedzy, a także racjonalnych przesłanek, które stanowią ich podstawę.
Kompetencje społeczne	<ol style="list-style-type: none">1. Student poznaje uwarunkowania, problemy i dylematy związane z zarządzaniem ryzykiem rynkowym i operacyjnym.2. Student uświadamia sobie, że zarządzanie ryzykiem wymaga wiedzy interdyscyplinarnej, której posiadanie jest warunkiem koniecznym efektywnego rozwiązywania problemów związanych z pomiarem i ograniczaniem poziomu ryzyka.

D. Tematyka zajęć

- 1 Ryzyko w działalności banków, instytucji finansowych i kredytowych (I).
- 2 Ryzyko w działalności banków, instytucji finansowych i kredytowych (II).
- 3 Dekompozycja ryzyka rynkowego - ryzyko stopy procentowej (I)
- 4 Ryzyko rynkowe - ryzyko stopy procentowej (II).
- 5 Ryzyko walutowe jak komponent ryzyka rynkowego
- 6 Ryzyko rynkowe a ryzyko kredytowe - przykład opcji walutowych w Polsce.
- 7 Wybrane techniki ograniczania ryzyka rynkowego (walutowego) oraz uwarunkowania ich zastosowania.
- 8 Metoda wartości zagrożonej
- 9 Pomiar ryzyka rynkowego - zmienność i wrażliwość
- 10 Definicja ryzyka operacyjnego. Klasyfikacja ryzyka operacyjnego i systematyka zdarzeń operacyjnych.
- 11 Główne przyczyny i czynniki wzrostu znaczenia ryzyka operacyjnego w bankach.
- 12 Proces zarządzania ryzykiem operacyjnym i klasyfikacja metod pomiaru Proste metody pomiaru ryzyka operacyjnego
- 13 Ilościowe metody pomiaru ryzyka operacyjnego. Ilościowo-jakościowe metody pomiaru ryzyka operacyjnego
- 14 Metody jakościowe i heurystyczne pomiaru ryzyka operacyjnego. Ograniczanie ryzyka operacyjnego. Kontrola wewnętrzna w banku
- 15 Regulacje nadzorcze dotyczące ryzyka operacyjnego i rynkowe

E. Literatura podstawowa (obowiązkowe podręczniki)

P. Niedziółka, Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w banku, Difin, Warszawa 2002r. P.Niedziółka, J. Nowakowski, J. Mieloszyk, Portfel Inwestycyjny banku - konstrukcja i zarządzanie portfelem papierów wartościowych, Difin, Warszawa 2002r, P. Niedziółka, Zastosowanie instrumentów pochodnych do zarządzania ryzykiem bankowym [w:] Współczesna bankowość - teoria i praktyka, red. M. Zaleska, Difin, Warszawa 2007r., P.Niedziółka, Andrzej Krysiak, Ryzyko cenowe [w:] Współczesna bankowość - teoria i praktyka, red. M. Zaleska, Difin, Warszawa 2007r. T.Bałamut, Metody estymacji Value at Risk, Materiały i Studia NBP nr 8/2002, Warszawa 2002; K.Jajuga, Zarządzanie ryzykiem, PWN, Warszawa 2007; J.Krasodomska, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym w bankach, Wyd. PWE, Warszawa 2008; P.Matkowski, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Wyd. Wolters Kluwer, Kraków 2006.

F. Literatura uzupełniająca

P.Best, Wartość narażona na ryzyko, Wyd. ABC, Kraków 2000; D.Gątarek, R.Maksymiuk, M.Krysiak, Ł.Witkowski, Nowoczesne metody zarządzania ryzykiem finansowym, WIG Press, Warszawa 2001; H.Riehl, Zarządzanie ryzykiem na rynku pieniężnym, walutowym i instrumentów pochodnych, WIB, Warszawa 2001; J.Zombirt, Nowa Umowa Kapitałowa. Ewolucja czy rewolucja, Wyd. CeDeWu, Warszawa 2007.

G. Najważniejsze publikacje autora(ów) dotyczące proponowanych zajęć

, red. Piotr Czapiewski, Paweł Niedziółka, Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, 2016

H. Sygnatury wymaganych prekwizytów

nie są wymagane

I. Wymiar i forma zajęć

	Stacj.	Sb.Niedz.
Ogółem:	30	14
Wykład	30	14

J. Elementy oceny końcowej

egzamin testowy (Test jednokrotnego wyboru) 100%

K. Wymagana znajomość języka obcego

nie jest wymagana

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

dyskusje
udział praktyków