



# Podmínky absolvování předmětu Řízení finančních a bankovních rizik

Pavla Klepková Vodová

# Struktura výkladu

- Rizika podnikání v bankovníctví
- Metody měření finančních rizik
- Měření úvěrového rizika
- Transfer úvěrového rizika, úvěrové deriváty
- Operační riziko
- Tržní riziko
- Riziko likvidity
- Rizikově očištěná výnosnost
- Kapitálová přiměřenost

# Povinná literatura

- SAUNDERS, A. *Credit Risk Measurement: New Approaches to Value at Risk and Other Paradigms*. New York: John Wiley & Sons, 1999. ISBN 0-471-35084-2.
- SIVÁK, R., GERTLER, L. *Teória a prax vybraných druhov finančných rizík (kreditné, trhové, operačné)*. Bratislava: Sprint-vfra, 2006. ISBN 80-89085-56-3.
- VODOVÁ, P. *Řízení finančních rizik A. Distanční studijní opora*. Karviná: OPF SU, 2006, kap. 1 – 3, 7 – 10. ISBN 80-7248-349-8.
- Aktuální opatření a vyhlášky České národní banky
- **Veškerá látka probíraná na přednáškách a seminářích!!!**

# Doporučená literatura

- ALLEN, S. *Financial risk management: a practitioner's guide to managing market and credit risk*. New Jersey: John Wiley & Sons, 2003. ISBN 0-471-21977-0.
- BESSIS, J. *Risk Management in Banking*. 2nd ed. Chichester: John Wiley & Sons, 2002. ISBN 0-471-893366.
- BIS *Credit risk transfer*. Basel: Bank for International Settlements, 2005.
- BRINK, G.J. *Operational risk: The new challenge for banks*. New York: Palgrave, 2002. ISBN 0-333-96868-9.
- COSSIN, D., PIROTTE, H. *Advanced Credit Risk Analysis*. Chichester: John Wiley & Sons, 2001. ISBN 0-471-98723-9.
- DAS, S. *Credit Derivatives. CDOs & Structured Credit Products*. Singapore: John Wiley & Sons, 2005. ISBN 978-0-470-82159-6.
- DEMPSTER, M.A.H. *Risk Management: Value At Risk and Beyond*. Cambridge: University Press, 2002. ISBN 0-521-78180-9.
- DVOŘÁK, P. *Bankovníctví pro bankéře a klienty*. Praha: Linde, 2005. ISBN 80-7201-515-X.
- MEJSTŘÍK, M., PEČENÁ, M., TEPLÝ, P. *Základní principy bankovníctví. Basic principles of banking*. Praha: Karolinum, 2008. ISBN 978-80-246-1500-4.
- KOCH, T.W., MACDONALD, S.S. *Bank Management*. 7th ed. Mason: South-Western Cengage Learning, 2010. ISBN 978-0-324-65578-0.
- POLOUČEK, S. a kol. *Bankovníctví*. Praha: C. H. Beck, 2006. ISBN 80-7179-462-7.
- ROSE, PS. *Commercial Bank Management*. New York: McGraw-Hill, 2002. ISBN 0-07-112122-6.
- SAUNDERS, A., CORNETT, M.M. *Financial Institutions Management: A Risk Management Approach* 4th ed. New York: McGraw-Hill, 2008. ISBN 978-007-126384-9.

# Podmínky absolvování

- dva průběžné testy
- aktivita na přednáškách a seminářích – online kvízy
- zkouška

# Průběžný test 1

- lze získat max. 15 bodů
- termín:
  - 9. listopadu 2021 na semináři
- struktura:
  - příklady z probraných témat č. 1 – 5 (viz prezentace a podkladové soubory)
  - k dispozici budou vybrané vzorce

# Průběžný test 2

- lze získat max. 15 bodů
- termín:
  - 14. prosince 2021 na semináři
- struktura:
  - příklady z probraných témat č. 6 – 10 (viz prezentace a podkladové soubory)
  - k dispozici budou vybrané vzorce

# Kvízy na přednáškách a seminářích

- lze získat max. 10 bodů
- vyplňování kvízů přes Socrative
  - správně více než 50 % odpovědí → získá 2 bodů





# Zkouška

- celkově lze získat max. 60 bodů
- termín:
  - ve zkouškovém období
- průběh ústní zkoušky:
  - odpovědi na dvě teoretické otázky (každá max. za 30 bodů)

# Hodnocení aktivit

• průběžný test 1	15 b.
• průběžný test 2	15 b.
• kvízy	10 b.
• <u>ústní zkouška</u>	<u>60 b.</u>
• celkem	100 b.

# Hodnocení

- A: 91 – 100 bodů
- B: 81 – 90 bodů
- C: 71 – 80 bodů
- D: 61 – 70 bodů
- E: 51 – 60 bodů
- F: 0 – 50 bodů



# Kontakt

- konzultační hodiny: A 336
  - pondělí 9:30 – 10:30, 12:30 – 13:00
  - úterý 11:30 – 13:00
- e-mail:
  - [klepkova@opf.slu.cz](mailto:klepkova@opf.slu.cz)
- MS Teams
- telefon:
  - 596 398 406



MĚJTE SE HEZKY

