

Název předmětu:

MKF_RRFI ŘÍZENÍ RIZIK FINANČNÍCH INSTITUCÍ

Počet kreditů:

6

Dotace výuky:

samostudium + konzultace

Způsob ukončení předmětu:

písemná zkouška

Obsahová náplň tutoriálů v PS 2022:

Téma	Tutor
Základní definice a pojmy risk managementu Klasifikace rizik v podnikání komerční pojišťovny Podnikatelská rizika pojišťovny Investiční (finanční) rizika pojišťovny Nefinanční rizika pojišťovny	Vávrová
Tržní riziko Value-at-risk a Expected shortfall Regulace finančních institucí Kreditní riziko, odhad pravděpodobnosti defaultu Scenario analysis, operační riziko a stress testing Riziko likvidity, ekonomický kapitál, finanční inovace	Plíhal

Výukové metody:

Tutoriály v podobě samostudia na základě materiálů dostupných v interaktivní osnově předmětu v IS MU, konzultace, diskuse vybraných aktuálních témat, samostatná práce, samostudium.

Organizace výuky:

Kombinovaná forma studia se kromě tutoriálů, které budou probíhat formou diskusí a konzultací, skládá z velké části ze samostudia. Tutoriály se týkají stěžejních částí látky, jejíž znalost je vyžadována u zkoušky. Konzultace slouží k vyjasnění problematických míst, která se objeví při samostudiu.

Základní zdroje a doporučená literatura:

Materiály dostupné v interaktivní osnově předmětu v IS MU.

CIPRA, T. *Riziko ve financích a pojišťovnictví: Basel III a Solvency II*. Praha: Ekopress, 2015. ISBN 978-80-87865-24-8.

DOFF, R. *Risk management for insurers: risk control, economic capital and Solvency II*. 3. ed. London: Riskbooks, 2015. ISBN 978-1-78272-222-9.

HULL, J.C. *Risk Management and Financial Institutions*. Hoboken: John Wiley & Sons, 2018. ISBN 978-1-119-44811-2.

VÁVROVÁ, E. *Finanční řízení komerčních pojišťoven*. Praha: Grada Publishing, 2014. ISBN 978-80-247-4662-3.