

## SYLABUS PRZEDMIOTU W SZKOLE DOKTORSKIEJ

<b>Tytuł</b>	<i>Bankowość</i>
Tytuł w jęz. ang.	Banking

<b>Status przedmiotu</b>	<b>obowiązkowy dla:</b> <i> kierunkowy SzD</i>
	<b>do wyboru dla:</b>

<b>Autor/autorzy sylabusa:</b>	Zespół :	koordynator: prof. dr hab. Małgorzata Zaleska
		członek zespołu: dr hab. Jan Koleśnik, prof. SGH
		członek zespołu: dr hab. Paweł Niedziółka, prof. SGH
		członek zespołu: dr hab. Izabela Pruchnicka-Grabias, prof. SGH
		członek zespołu: dr hab. Emil Ślęzak, prof. SGH

**Sygnatura przedmiotu:**

### Część A

**1. Syntetyczna charakterystyka przedmiotu (główne hasła – około 400 znaków):**

Celem zajęć jest zaznajomienie słuchaczy z głównymi nurtami teorii ekonomii bankowej ze szczególnym uwzględnieniem elementów aplikacji koncepcji w praktyce bankowej i związanej z tym transformacji funkcjonowania współczesnego systemu bankowego.

**2. Słowa kluczowe (3 – 6 słów):**

bank, system bankowy, sieć bezpieczeństwa finansowego, regulacje ostrożnościowe, zarządzanie bankiem, ryzyko bankowe

### Część B

**Przedmiotowe efekty uczenia się**

**Powiązanie z efektami uczenia się dla SzD**

**Wiedza (liczba efektów od 2 do 5)**

W.1

Rozumieć system uwarunkowań ekonomicznych w funkcjonowaniu współczesnego systemu bankowego

W\_1

W.2	Posiadać wiedzę na temat roli i znaczenia poszczególnych instytucji sieci bezpieczeństwa finansowego	W_2 W_3
W.3	Posiadać wiedzę w zakresie ilościowych i jakościowych regulacji ostrożnościowych dotyczących poszczególnych komponentów ryzyka bankowego	W_2 W_3
W.4	Posiadać wiedzę na temat zasad zarządzania ryzykiem w banku oraz interakcji pomiędzy różnymi rodzajami ryzyka bankowego	W_2 W_3
W.5	Znać istotę pochodnych instrumentów finansowych i kredytowych	W_2 W_3
<b>Umiejętności (liczba efektów od 2 do 5)</b>		
U.1	Przeprowadzać analizę porównawczą pomiędzy różnymi systemami bankowymi	U_1 U_2 U_3 U_4 U_5
U.2	Oceniać zmiany instytucjonalne i regulacyjne dotyczące banków i systemu bankowego	U_1 U_2 U_3 U_4 U_5
U.3	Identyfikować zależności pomiędzy różnymi rodzajami ryzyka bankowego	U_1 U_2 U_3 U_4 U_5
U.4	Mierzyć poziom ryzyka kredytowego, rynkowego, operacyjnego, płynności oraz systemowego	U_1 U_2 U_3 U_4 U_5
U.5	Wybierać optymalną dla danego banku w określonym otoczeniu strategię zarządzania ryzykiem	U_1 U_2 U_3 U_4 U_5
<b>Kompetencje społeczne (liczba efektów od 1 do 3)</b>		
K.1	Wykazywać inicjatywę do samodzielnego rozwoju nabytej wiedzy i umiejętności	K_1 K_2
K.2	Formułować samodzielne sądy w kwestiach związanych z bankowością	K_1 K_2 K_3
K.3	Wykazywać elastyczność i racjonalność myślenia w podejmowaniu decyzji	K_1 K_2 K_3

## Część C

### Semestralny plan zajęć:

1. Makroekonomiczne uwarunkowania działalności banku
2. Bank jako pośrednik finansowy w warunkach asymetrii informacji
3. Konstrukcja współczesnego systemu bankowego
4. Sieć bezpieczeństwa finansowego - instytucje i instrumenty przez nie stosowane
5. Rola banku centralnego jako instytucji odpowiadającej za stabilność cen oraz stabilność finansową
6. Zewnętrzne ograniczenia w swobodzie prowadzenia działalności bankowej
7. Ryzyko w działalności bankowej – dekompozycja oraz wzajemne zależności między rodzajami ryzyka

bankowego
8. Zarządzanie ryzykiem w banku – kwantyfikacja i ograniczanie za pomocą technik tradycyjnych oraz innowacyjnych
9. Złożone finansowe instrumenty pochodne oraz ryzyko związane z ich stosowaniem przez banki
10. Kredytowe instrumenty pochodne oraz ich rola w działalności bankowej
11. Nadużycia na rynkach finansowych oraz rola banków w tym procesie
12. System "wolnej bankowości"
13. System "bankowości równoległej"
<p><b>Literatura podstawowa</b> (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. M. Zaleska (red.), Świat bankowości, Difin, Warszawa 2019</li> <li>2. J. Koleśnik, Bezpieczeństwo systemu bankowego. Teoria i praktyka, Difin, Warszawa 2011</li> <li>3. I. Pruchnicka-Grabias, Pochodne instrumenty kredytowe. Systematyka, wycena, zastosowanie, Wydawnictwa fachowe CeDeWu, Warszawa 2018, wydanie 2</li> <li>4. E. Ślęzak, Idiosynkratyczne funkcje banku - ujęcie teoretyczno-praktyczne, Oficyna Wydawnicza Szkoły Głównej Handlowej w Warszawie, Warszawa 2015</li> <li>5. J. Hull, Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2017</li> <li>6. J. Bessis, Risk Management in Banking, Wiley, 2015</li> <li>7. S. Bouteille, D. Coogan-Puschner, The Handbook of Credit Risk Management: Originating, Assessing, and Managing Credit Exposures, Wiley Finance, 2013</li> </ol>
<p><b>Literatura uzupełniająca</b> (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. P. Czapiewski, P. Niedziółka, Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, Difin, Warszawa 2016</li> <li>2. L. Allen, A. Saunders, Risk Management in Banking [in] Allen N. Berger, Philip Molyneux, John</li> <li>3. O. S. Wilson (ed.), The Oxford Handbook of Banking, Second Edition Oxford 2014</li> <li>4. T. C. Wilson, Value and Capital Management: A Handbook for the Finance and Risk Functions of Financial Institutions, The Wiley Finance Series, 2015</li> <li>5. P. Niedziółka, Analiza potencjalnych korzyści oraz negatywnych konsekwencji wdrożenia norm LCR oraz NSFR w bankach europejskich, Kwartalnik Kolegium Ekonomiczno-Społecznego. Studia i Prace 1 (3), 207-226</li> <li>6. I. Pruchnicka-Grabias, A. Szelałowska, Agencje ratingowe a rynki akcji i obligacji, Wydawnictwa fachowe CeDeWu, Warszawa 2019</li> <li>8. I. Pruchnicka-Grabias, Egzotyczne opcje finansowe. Systematyka, wycena, strategie, Wydawnictwa fachowe CeDeWu, Warszawa 2016, wydanie 5</li> </ol>

9. N. Gennaioli, A. Shleifer, R. W. Vishny, A model of shadow banking. *The Journal of Finance*, no. 68(4), 2013, s. 1331-1363
10. S. I. Greenbaum, A. V. Thakor, A. Boot, eds. *Contemporary financial intermediation*, Academic Press, 2015

<b>Część D</b>	
<b>Forma zajęć:</b>	<b>Wymiar zajęć w godz.:</b>
Ogółem godzin <i>w tym:</i>	45
Wykład	45
<b>Elementy oceny końcowej (ogółem 100%), w tym:</b>	
egzamin pisemny	50%
Test	50%
<b>Liczba punktów ECTS</b>	5

<b>Część E</b>
<b>Metody dydaktyczne (nauczania) stosowane przez prowadzącego</b>
M.2. wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych M.3. wykład konwersatoryjny (z <i>aktywnością doktorantów</i> )

<b>Część F</b>
<b>Metody weryfikacji (sprawdziany) osiągnięcia przedmiotowych efektów kształcenia</b>
W.1. egzamin pisemny ( <i>pytania otwarte, zadania</i> ) W.4. test