



KAUNO TECHNOLOGIJOS UNIVERSITETAS

STUDIJŲ MODULIO PROGRAMA (SMP)

Modulio kodas	S	181	M	109	Atestuotas iki	2019	09	01	Atnaujinimo data		
	Mokslų šaka	Progr.	Registr. Nr.								

Pavadinimas

Rizikos valdymas

Būtinasis pasirengimas modulio studijoms

Finansų institucijų valdymas

Pagrindinis tikslas

Įsisavinti finansų mokslo teorines žinias ir įgyti analitinius gebėjimus, būtinus identifikuoti rizikas naujoje, nuolat kintančioje aplinkoje, išmanyti draudimo įmonių draudiminės ir finansinės veiklos analizės metodų taikymo ribas, priimti valdymo sprendimus inovatyvumo ir žinių integracijos reikalaujančioje praktinėje veikloje bei efektyviai veikti aplinkybėmis, kai stokojama išsamios informacijos ir instrukcijų.

Siekiami modulio studijų rezultatai

Eil.nr.	Rezultatai	Studijų metodai	Studento pasiekimų vertinimo metodai
1	Geba analizuoti naujausius rizikos valdymo metodus ir pagrindinius valdymo etapus.	Diskusija, Kviestinių dėstytojų (praktikų) paskaitos, Paskaita	Tarpinis egzaminas, Žodinis iliustruotas pranešimas
2	Geba įvertinti rizikos dydį ir priimti adekvачius rizikos valdymo sprendimus nuolat kintančioje aplinkoje.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Debatai, Laboratoriniai darbai, Praktinės užduotys	Laboratorinio darbo savarankiškas atlikimas, Probleminių sprendimų užduotis, Tarpinis egzaminas
3	Geba taikyti šiuolaikinius rizikos organizavimo ir valdymo metodus bei principus pagal situacijas.	Darbas grupėse, Diskusija, Laboratoriniai darbai, Problemų sprendimo sesijos	Laboratorinio darbo savarankiškas atlikimas, Probleminių sprendimų užduotis, Tarpinis egzaminas
4	Geba pasirinkti adekvачius rizikos valdymo sprendimus nuolat kintančioje aplinkoje.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Diskusija, Paskaita	Probleminių sprendimų užduotis, Tarpinis egzaminas, Žodinis iliustruotas pranešimas
5	Geba priimti ekonomiškai pagrįstus investicinio portfelio valdymo sprendimus pagal finansinės rizikos modeliavimus.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Debatai, Laboratoriniai darbai	Laboratorinio darbo savarankiškas atlikimas, Tarpinis egzaminas, Žodinis iliustruotas pranešimas
6	Geba taikyti sisteminių ir dinaminį požiūrį, objektyviai nustatant išorinius ir vidinius rizikos veiksnius.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Diskusija, Paskaita	Egzaminas raštu, Žodinis iliustruotas pranešimas
7	Geba pagrįsti finansinės rizikos valdymo modelius, finansinės rizikos mažinimo bei valdymo priemones ir pasirinkti tinkamą modelį sprendžiant problemas.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Paskaita, Praktinės užduotys	Egzaminas raštu, Žodinis iliustruotas pranešimas
8	Gebėti nuolat savarankiškai mokytis, pažinti ir kritiškai vertinti draudimo įmonių veiklos valdymo naujoves.	Atvejo analizė (atvejo studijos), Diskusija	Egzaminas, Referatas, Tarpinis egzaminas, Žodinis iliustruotas pranešimas

Eil.nr.	Rezultatai	Studijų metodai	Studento pasiekimų vertinimo metodai
9	Geba komunikuoti mokslines idėjas, metodus bei technologijas, nagrinėjant praktines rizikos valdymo problemas.	Debatatai, Diskusija, Rekomenduojami skaitiniai	Egzaminas, Tarpinis egzaminas, Žodinis iliustruotas pranešimas

Anotacija

Įgyjamos teorinės žinios ir gebėjimai būtini rizikos nustatymui, draudimo įmonių draudiminės ir finansinės veiklos analizei, vertinimui bei valdymo sprendimų priėmimui, inovatyvumo ir žinių integracijos reikalaujančioje praktinėje veikloje bei efektyviai veikti aplinkybėmis, kai stokojama išsamios informacijos ir instrukcijų. Gebama analizuoti ir vertinti išorinių bei vidinių veiksnių poveikį draudimo įmonės investicinei veiklai ir finansiniam stabilumui globalioje aplinkoje, taikyti sisteminių ir dinaminį požiūrį parenkant adekvačias draudimo priemones bei perdraudimo rūšis, suvokiant priimamų sprendimų padarinius ir atsakomybę už juos.

Modulio paskirtis

Universitetinių studijų lygmuo		Dalykų grupė	Dalyko lygis
Pakopa	Laipsnis		
Antroji	Magistro	Studijų krypties gilinimosi	Gilinamasis

Studijų sritis arba kryptis pagal studijų finansavimo metodiką

1. Humanitarinių mokslų studijų srities studijų kryptys (išskyrus filologiją), socialinių mokslų srities studijų kryptys (išskyrus psichologiją, švietimą ir ugdymą, visuomenės saugumą)

Dalys (skiriai) ir temos

Eil. Nr.	Pavadinimai
1.	Įvadas į rizikos teoriją
2.	Finansinės rizikos rūšys ir rizikos šaltiniai
3.	Rizikos rūšys, jų identifikavimo ir įvertinimo metodai
4.	Rizikos valdymo procesas
5.	Rizikos valdymo priemonės ir etapai
6.	Rizikos matai ir jų taikymas finansinės rizikos vertinimo procese
7.	Rizikos valdymo metodai, jautrumo analizė ir scenarijų analizė
8.	Rizikos vertės (VaR) modelis ir jo taikymas finansinės rizikos modeliavime
9.	Finansinės rizikos valdymas išvestinėmis finansinėmis priemonėmis
10.	Pasirinkimo sandorių (options) rizikos valdymas. Graikiškosios raidės (The greeks)
11.	Testavimas nepalankiausiomis sąlygomis (stress testing) ir atgalinis testavimas (backtesting) rizikos valdymo procese
12.	Draudimas kaip rizikos valdymo priemonė
13.	Rizikos vertinimas ir ne gyvybės draudimo politika kaip verslo sprendimų priėmimo dalis
14.	Rizikos vertinimas gyvybės draudimo ir pensijų kaupimo veikloje

Žinių ir gebėjimų įvertinimo tvarka:

Taikoma dešimtbalė kriterinė skalė ir kaupiamoji vertinimo schema. Semestro savarankiško darbo užduotys vertinamos pažymiu, egzaminų sesijos metu nustatomas galutinis pažymys, atskirus pažymius padauginant iš svertinio koeficiento ir sandaugas susumuojant.

Pagrindinė literatūra

Eil.Nr.	Pavadinimas	Leidinio KTU bibliotekoje		Ar yra KTU knygyne	Egz. sk. fak. metod. kab.
		šifras	egz. sk.		
1.	Iverson, D. Strategic risk management : a practical guide to portfolio risk management. Singapore : Wiley, 2013	D211760	1	Ne	
2.	Batten, J., MacKay, J., Wagner, N. F. Advances in financial risk management: corporates, intermediaries and portfolios. New York [N.Y.] : Palgrave Macmillan, 2013.	D212096	1	Ne	
3.	Bunni, Nael G. Risk and insurance in construction .London : Spon Press, 2011.	D211958	1	Ne	

