

KARTA PRZEDMIOTU

1.	NAZWA PRZEDMIOTU: Zarządzanie ryzykiem
2.	KIERUNEK: Finanse i rachunkowość
3.	POZIOM STUDIÓW: II stopnia
4.	ROK/ SEMESTR STUDIÓW: II/3
5.	LICZBA PUNKTÓW ECTS: 3
6.	TYP PRZEDMIOTU ¹ : obowiązkowy
7.	JĘZYK WYKŁADOWY: polski
8.	LICZBA GODZIN I FORMA REALIZACJI PRZEDMIOTU ² : 30 WY, 30 ZP- studia stacjonarne (SS), 15 WY, 15 ZP- studia stacjonarne (SS),
9.	WYMAGANIA WSTĘPNE: zaliczenie kursów: Matematyka finansowa, Statystyka opisowa, Elementy ekonometrii, Podstawy finansów, Finanse przedsiębiorstw, Rynki finansowe

10.	ZAŁOŻENIA I CELE PRZEDMIOTU: <ul style="list-style-type: none"> • Zapoznanie studentów z podstawową terminologią, teoriami i mechanizmami zarządzania ryzykiem. • Rozwijanie wśród studentów umiejętności oceny ryzyka towarzyszącego podejmowaniu decyzji we współczesnych instytucjach gospodarczych w tym finansowych
-----	---

11.	PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się (symbol)
	WIEDZA: zna i rozumie	
P_W01	w pogłębionym stopniu teorie i mechanizmy zarządzania ryzykiem	K_W02, K_W07
P_W02	terminologię i narzędzia oraz techniki używane w obszarze zarządzania ryzykiem	K_W08
P_W03	procesy leżące u podstaw zmienności cen instrumentów finansowych oraz możliwościach ich modelowania	K_W04, K_W05

¹ Obowiązkowy, fakultatywny.

² Wykłady, ćwiczenia, laboratoria, konwersatoria.

	UMIEJĘTNOŚCI: potrafi	
P_U01	znaleźć odpowiednie informacje, w tym dane statystyczne umożliwiające identyfikowanie czynników ryzyka związanych z aktywnością inwestycyjną i tworzenie strategii inwestycyjnych	K_U02
P_U02	dokonać pomiaru różnych rodzajów ryzyka oraz sporządzić modele i przeprowadzić optymalizację decyzji inwestycyjnych pod minimalizujących ryzyko.	K_U02, K_U04, K_U06
	KOMPETENCJE SPOŁECZNE: jest gotów do	
P_K01	Ma świadomość swojej wiedzy i umiejętności, rozumie potrzebę nieustannego uczenia się i rozwoju kompetencji osobistych oraz interpersonalnych, potrafi wyznaczać kierunki własnego rozwoju i kształcenia, uzupełniać i doskonalić nabytą.	K_K01

12.	METODY OCENY EFEKTÓW UCZENIA SIĘ			
	Symbol przedmiotowego efektu uczenia się	Metody (sposoby) oceny³	Typ oceny⁴	Forma dokumentacji
1.	P_W01, P_W02, P_W03	Egzamin ustny	podsumowująca	Protokół ocen, Zestawy pytań
2.	P_U01, P_U02	Śródsemestralne prace zaliczeniowe	formująca	Kolokwium, w formie pisemnej lub elektronicznej
3.	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02	Ocenianie ciągłe	formująca	Dyskusja podczas zajęć

13. KRYTERIA OCENY OSIĄGNIĘTYCH EFEKTÓW UCZENIA SIĘ

Forma oceny: punktowa

EFEKTY UCZENIA SIĘ	NA OCENĘ 3,0	NA OCENĘ 3,5	NA OCENĘ 4.0	NA OCENĘ 4,5	NA OCENĘ 5,0
P_W01	5	6	7	8	9
P_W02	5	6	7	8	9
P_U01	5	6	7	8	9
P_U02	5	6	7	8	9

³ Ocenianie ciągłe (bieżące przygotowanie do zajęć), śródsemestralne zaliczenie pisemne, śródsemestralne zaliczenie ustne, końcowe zaliczenia pisemne, końcowe zaliczenia ustne, egzamin pisemny, egzamin ustny, praca semestralna, ocena umiejętności ruchowych, praca dyplomowa, projekt, kontrola obecności

⁴ Formująca, podsumowująca.

P_K01	5	6	7	8	9	
<p>Oceny efektów P_W01 oraz P_W02 P_W03 są podstawą zdania egzaminu, przy czym ocena końcowa jest średnią arytmetyczną ocen trzech efektów, pod warunkiem, że z obu student otrzymał przynajmniej ocenę 3. Jeżeli przynajmniej jeden efekt nie zostanie zaliczony ocena końcowa jest niedostateczna. W trybie poprawkowym student ma możliwość zaliczenia efektów niezaliczonych w trybie zasadniczym.</p> <p>Oceny efektów z zajęć praktycznych P_U01 i PU_02 są podstawą zaliczenia zajęć praktycznych. Dodatkowe uwagi jak wyżej.</p>						

14. WARUNKI UZYSKANIA ZALICZENIA PRZEDMIOTU:
<p>Osiągnięcie założonych efektów uczenia się i pozytywny wynik</p> <ol style="list-style-type: none"> egzaminu pisemnego zaliczenia pisemnych kolokwίων

15.	TREŚCI PROGRAMOWE		
	Treść zajęć	Forma zajęć⁵ (liczba godz.) SS/SN	Symbol przedmiotowych efektów uczenia się
Wykłady			
1.	Ryzyko. Podstawowe pojęcia <ul style="list-style-type: none"> Pojęcie ryzyka Zarządzanie ryzykiem i jego rozwój Rodzaje ryzyka Proces zarządzania ryzykiem 	4/2	P_W02
2.	Teoretyczne podstawy pomiaru ryzyka <ul style="list-style-type: none"> Miary wynikające z rozkładów statystycznych ryzyka Miary wrażliwości Pomiar ryzyka ekstremalnego Pomiar ryzyka na podstawie ocen subiektywnych 	4/2	P_W01
3.	Zarządzanie ryzykiem cen akcji <ul style="list-style-type: none"> Pomiar ryzyka cen akcji Strategie zarządzania ryzykiem cen akcji 	4/2	P_W03
4.	Zarządzanie stopy procentowej <ul style="list-style-type: none"> Definicja ryzyka stopy procentowej i jego klasyfikacja Pomiar ryzyka stopy procentowej Strategie zarządzania ryzykiem stopy procentowej 	4/2	P_W02
5.	Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego	2/1	P_W02
6.	Zarządzanie ryzykiem kredytowym <ul style="list-style-type: none"> Pomiar ryzyka kredytowego Modele ryzyka kredytowego 	2/1	P_W02, P_W03

7.	Zarządzanie ryzykiem za pomocą instrumentów pochodnych	2/1	P_W01, P_W02
8.	Zarządzanie ryzykiem w banku <ul style="list-style-type: none"> Ryzyko działalności bankowej Ryzyko operacyjne w banku Ryzyko kredytowe w banku Ryzyko informatyczne w działalności bankowej 	4/2	P_W01, P_W02
9.	Zarządzanie ryzykiem w działalności ubezpieczeniowej <ul style="list-style-type: none"> Rozdaje ryzyka i pomiar ryzyka w działalności ubezpieczeniowej Modele ryzyka ubezpieczeniowego Kalkulacja składek ubezpieczeniowych 	2/1	P_W01, P_W02
10.	Zarządzanie ryzykiem w rzeczowych przedsięwzięciach inwestycyjnych	2/1	P_W01, P_W02

Zajęcia praktyczne

1.	Miary ryzyka: miary wynikające z rozkładu statystycznego, miary wrażliwości	3/1	P_U01
2.	Ryzyko zwykłe i ekstremalne	1/1	P_U02
3.	Ryzyko rynkowe – strategie sterowania ryzykiem: przepływy pieniężne, portfel aktywów, kurs walutowy	6/2	P_U02
4.	Kolokwium	2/1	
5.	Ryzyko kredytowe – modele ryzyka kredytowego	2/1	P_U02
6.	Pomiar ryzyka kredytowego – modele scoringowe	6/3	P_U02
7.	Pomiar i modele ryzyka ubezpieczeniowego	1/1	P_U02
8.	Kalkulacja składki ubezpieczeniowej	1/1	P_U01, P_U02
9.	Zarządzanie ryzykiem przez instrumenty pochodne: opcje, kontrakty terminowe, kontrakty swap	6/3	P_U02
10.	Kolokwium	2/1	

16.	METODY I FORMY PROWADZENIA ZAJĘĆ	Tak (X) / nie
	Wykład z prezentacją multimedialną wybranych zagadnień	X

Wykład konwersatoryjny	X
Wykład problemowy	
Wykład informacyjny	
Dyskusja	X
Praca z tekstem	
Metoda analizy przypadków	
Uczenie problemowe (<i>Problem-based learning</i>)	
Gra dydaktyczna/symulacyjna	
Metoda ćwiczeniowa	X
Metoda warsztatowa	
Metoda projektu	
Prezentacja multimedialna	
Demonstracje dźwiękowe i/lub video	
Metody aktywizujące (np.: „burza mózgów”, technika analizy SWOT, technika drzewka decyzyjnego, metoda „kuli śniegowej”, konstruowanie „map myśli”)	
Praca w grupach	
Praca indywidualna ze studentem (w tym tutoring)	
Inne (jakie?) -	

17. **LITERATURA PODSTAWOWA I UZUPEŁNIAJĄCA⁶:**

Literatura podstawowa:

1. Jajuga K., *Zarządzanie ryzykiem*. Wyd. 2, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2018.
2. Jajuga K., Jajuga T., *Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa*. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015.
3. Wawrzyniak D., *Ryzyko informatyczne w działalności bankowej*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, Wrocław 2012.
4. Orzeł J., *Zarządzanie ryzykiem operacyjnym za pomocą instrumentów pochodnych*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2012
5. Rogowska W., Michalczewski A., *Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwach inwestycyjnych*, Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2005.

Literatura uzupełniająca:

1. E.J. Anderson, *Business Risk Management. Models and Analysis*. Wiley, Chichester 2014.
2. M.B. Miller, *Mathematics and Statistics for Financial Risk Management*. Wiley, Hoboken 2014.
3. E. Chancellor, *Historia spekulacji finansowych*. Warszawskie Wydawnictwo

	Literackie MUZA, Warszawa 2001.
--	---------------------------------

18.	OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA			
	Forma aktywności	Rodzaj zajęć	Liczba godzin na zrealizowanie aktywności w semestrze	
			Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
	Wykłady	Zajęcia wymagające udziału Prowadzącego	30	15
	zajęcie praktyczne		30	15
	Ćwiczenia			
	Laboratoria			
			
			
	<i>Łączna liczba godzin zajęć realizowanych z udziałem prowadzącego</i>		60	30
	przygotowanie się do zajęć	Praca własna studenta	3	10
	przygotowanie się do zaliczeń/kolokwiiów		5	15
	przygotowanie się do egzaminu/zaliczenia końcowego		7	20
			
	<i>Łączna liczba godzin pracy własnej studenta</i>		15	45
	<i>Razem godzin</i> <i>(zajęcia z udziałem prowadzącego + praca własna studenta)</i>		75	75
	Liczba punktów ECTS		3	

19.	PROWADZĄCY PRZEDMIOT (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL, INSTYTUT, NR POKOJU KONSULTACJI) Zgodnie z przedstawioną we wniosku do Ministerstwa Edukacji i Nauki planowaną obsadą zajęć dla studiów II stopnia na kierunku finanse i rachunkowość.
-----	--