



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Ryzyko w przedsiębiorstwie, PG_00037846						
Kierunek studiów	Ekonomia						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2019 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2021/2022		
Poziom kształcenia	I stopnia - licencjackie	Grupa zajęć			Grupa zajęć fakultatywnych Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne	Sposób realizacji			mieszane (blended-learning)		
Rok studiów	3	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	5	Liczba punktów ECTS			3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr hab. Błażej Prusak				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu		dr hab. Błażej Prusak				
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	15.0	0.0	0.0	0.0	30
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 15.0						
	Ryzyko w przedsiębiorstwie - stac. 2021/2022 - Moodle ID: 16720 https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=16720						
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów	Udział w konsultacjach		Praca własna studenta		RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	30	5.0		40.0		75
Cel przedmiotu	Nabycie umiejętności identyfikacji i pomiaru poszczególnych rodzajów ryzyka, a także zapoznanie się z metodami zabezpieczania przed wybranymi rodzajami ryzyk.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu			Sposób weryfikacji i oceny efektu	
	[K6_U15] umie doskonalić się poprzez systematyczne pozyskiwanie wiedzy i umiejętności		Student potrafi znaleźć i dobrać odpowiednie metody w procesie zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie.			[SU1] Ocena realizacji zadania	
	[K6_W07] ma wiedzę na temat podstawowych metod ilościowych i jakościowych wykorzystywanych w naukach ekonomicznych		Student potrafi wykorzystać podstawowe miary oraz metody (np. VaR, odchylenie standardowe, semiodchylenie standardowe, mapa ryzyka) do pomiaru ryzyka w przedsiębiorstwie.			[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej	
	[K6_U07] potrafi zidentyfikować czynniki, które należy uwzględnić w podejmowaniu decyzji na poziomie mikro i makroekonomicznym		Student identyfikuje różnego rodzaju ryzyka w wybranych typach przedsiębiorstw.			[SU5] Ocena umiejętności zaprezentowania wyników realizacji zadania	
	[K6_U05] potrafi diagnozować i prognozować procesy oraz zjawiska gospodarcze z wykorzystaniem metod i narzędzi właściwych dla nauk ekonomicznych		Student potrafi zastosować odpowiednie metody do zabezpieczenia się przed wybranymi rodzajami ryzyk.			[SU1] Ocena realizacji zadania [SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi	
Treści przedmiotu	Pojęcie i rodzaje ryzyka. Kalkulacja podstawowych miar ryzyka. Tworzenie mapy ryzyka. Diagram Ishikawy. Risk-score. Ocena ryzyka za pomocą analizy scenariuszy oraz analizy wrażliwości. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem walutowym, stopy procentowej i pogodowym. Pojęcie i rozliczanie transakcji CDS.						
Wymagania wstępne i dodatkowe	Zarządzanie finansami.						

Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
		Kolokwium	60.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<p>1. Benett D.: Ryzyko walutowe. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000. 2. (red.) Jajuga K.: Zarządzanie ryzykiem. PWN, Warszawa 2007 oraz wydanie II, Warszawa 2019. 3. Kaczmarek T.T.: Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Difin, Warszawa 2005. 4. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2009. 5. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2007. 6. Karkowski P.: Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. GreenCapital.pl, Warszawa 2009. 7. Maliszewski J.: Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie, Wydawnictwo Linia, Warszawa 2013. 8. Preś J.: Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Cedewu, Warszawa 2007. 9. Prusak B.: Swapy odmowy zapłaty, Finanse, https://www.researchgate.net/publication/286060552_Swapy_odmowy_zaplaty, 2009. 10. Rudnicki R.: (RMC), Konstruowanie mapy ryzyka, http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf. 11. Tarczyński W., Mojsiewicz M.: Zarządzanie ryzykiem. PWE, Warszawa 2001.</p>	
	Uzupełniająca lista lektur	<p>1. Best P. Wartość narażona na ryzyko. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000. 2. Sopoćko A.: Rynkowe instrumenty finansowe. Wydawnictwo Wyższej Szkoły przedsiębiorczości i Zarządzania im. Leona Koźmińskiego, Warszawa 2003, s. 188-218. 3. Woźniak J., Wereda W. (red.). Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją, CeDeWu, Warszawa 2018 (rozdziały 5 i 6 - fakultatywnie). 4. Czajkowska A.. Metody identyfikacji ryzyka w zarządzaniu ryzykiem w przedsiębiorstwie. Journal of Modern Management Process, nr 1(2)/2017, s. 40-49, https://docplayer.pl/60296596-Metody-identyfikacji-ryzyka-w-zarządzaniu-ryzykiem-w-przedsiębiorstwie.html. 5. Pyka I., Czech M.. Kontrakty CDS w roli nowoczesnego parametru oceny ryzyka kredytowego kraju. Studia Ekonomiczne. Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, nr 356, 2018, s. 124-145, https://sbc.org.pl/dlibra/docmetaddata?showContent=true&id=329985. 6. Błach J., Wieczorek-Kosmala M.. Catastrophe Bonds as Innovative Tools of Corporate Financial Management Application and Limitations, https://www.ue.katowice.pl/fileadmin/user_upload/WFiU/katedry/kat-fin-przeds-i-ubezp-gosp/Publikacja_Cat_bonds.pdf (14.09.2021). 7. Błachowski D.. Ryzyko pogodowe i pogodowe instrumenty pochodne w przedsiębiorstwie energetycznym. Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego, Finanse, Rynki Finansowe, Ubezpieczenia, nr 640 (38), 2011, s. 639-648, http://wneiz.pl/nauka_wneiz/frfu/38-2011/FRFU-38-639.pdf.</p>	
	Adresy eZasobów		

Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	<p>Zad. 1</p> <p>Przedsiębiorstwo zainwestowało w portfel akcji 100 mln zł. Przy założeniu poziomu tolerancji 0,05 (5%), horyzontu czasowego 10 dni roboczych oraz mając daną wartość odchylenia standardowego dziennych stóp zwrotu z portfela (2,5%) należy wyznaczyć i zinterpretować wartość VAR.</p> <p>Zad. 2</p> <p>Przedsiębiorstwo jest zarazem importerem i eksporterem a rozliczanie transakcji z podmiotami zagranicznymi odbywa się za pomocą USD. W dniu 10.09.2008 otrzymało 100 000 USD z tytułu sprzedaży produktów, natomiast za miesiąc będzie musiało zapłacić za materiały również kwotę 100 000 USD. Ze względu na obecny brak gotówki krajowej niezbędna jest zamiana USD na PLN.</p> <p>Korzystając z poniższych informacji przeprowadź kalkulację z wykorzystaniem swapa, przy założeniu dwóch wariantów kursu USD/PLN za miesiąc.</p> <p>Informacje:</p> <p>Nominał: 100 000 USD</p> <p>Kurs spot na dzień 10.09.2008: 2,4535/2,4565</p> <p>Kurs terminowy: 2,4585/2,4615</p> <p>Pytania:</p> <p>1) Wymień metody zabezpieczenia wewnętrznego przed ryzykiem kursowym.</p> <p>2) Wymień i scharakteryzuj instrumenty zewnętrzne zabezpieczające przed ryzykiem walutowym.</p>
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy