



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM, PG_00049635						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2021 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2023/2024		
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	niestacjonarne	Sposób realizacji			na uczelni		
Rok studiów	3	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	5	Liczba punktów ECTS			4.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot						
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	0.0	16.0	0.0	0.0	0.0	16
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
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	16		10.0		74.0	100
Cel przedmiotu	Zapoznanie się z metodami zabezpieczania przed różnymi rodzajami ryzyk oraz nabycie umiejętności kalkulacji ryzyka.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K6_U08] Posiada umiejętność zastosowania narzędzi matematycznych i informatycznych do analizowania zjawisk ekonomicznych i podejmowania decyzji przez podmioty gospodarcze.		Student potrafi dobrać i zastosować odpowiednie instrumenty zabezpieczające przed ryzykami: stopy procentowej, walutowym pogodowym.		[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi		
	[K6_W09] Zna sposoby i narzędzia pozyskiwania i gromadzenia danych, w tym również informatyczne, wykorzystywanych w analizie i wyjaśnianiu zjawisk i procesów społeczno-gospodarczych.		Student jest w stanie zdefiniować pojęcie ryzyka i określić podstawowe rodzaje ryzyk w przedsiębiorstwie.		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej		
Treści przedmiotu	Pojęcie i rodzaje ryzyk. Kalkulacja podstawowych miar ryzyka. Tworzenie mapy ryzyka. 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%		100.0%		

Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<p>1. Benett D.: Ryzyko walutowe. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000.</p> <p>2. (red.) Jajuga K.: Zarządzanie ryzykiem. PWN, Warszawa 2007.</p> <p>3. Kaczmarek T.T.: Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Difin, Warszawa 2005.</p> <p>4. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2009.</p> <p>5. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2007.</p> <p>6. Karkowski P.: Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. GreenCapital.pl, Warszawa 2009.</p> <p>7. Maliszewski J.: Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie, Wydawnictwo Linia, Warszawa 2013.</p> <p>8. Preś J.: Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Cedewu, Warszawa 2007.</p> <p>9. Prusak B.: Swapy odmowy zapłaty, Finanse, http://www.e-finanse.com/artykuly/110.pdf, 2009.</p> <p>10. Rudnicki R: (RMC), Konstruowanie mapy ryzyka, http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf.</p> <p>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.</p> <p>2. Sopoćko A.: Rynkowe instrumenty finansowe. Wydawnictwo Wyższej Szkoły przedsiębiorczości i Zarządzania im. Leona Koźmińskiego, Warszawa 2003, s. 188-218.</p>
	Adresy eZasobów	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Zad. 1	<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>
	Zad. 2	<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	