



Karta przedmiotu

| | | | | | | | |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|-------|
| Nazwa i kod przedmiotu | ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE, PG_00058536 | | | | | | |
| Kierunek studiów | Analityka gospodarcza | | | | | | |
| Data rozpoczęcia studiów | październik 2022 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 | stacjonarne | Sposób realizacji | | | na uczelni | | |
| Rok studiów | 2 | Język wykładowy | | | polski | | |
| Semestr studiów | 4 | Liczba punktów ECTS | | | 3.0 | | |
| Profil kształcenia | ogólnoakademicki | Forma zaliczenia | | | zaliczenie | | |
| Jednostka prowadząca | Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów | | | | | | |
| Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców) | Od 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 | 0.0 | 30.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 30 |
| | W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0 | | | | | | |
| | Adres na platformie eNauczanie: https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=20767 | | | | | | |
| 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 | Opisuje metody zabezpieczania przed różnymi rodzajami ryzyk oraz ich identyfikacji i kalkulacji. | | | | | | |
| Efekty uczenia się przedmiotu | Efekt kierunkowy | | Efekt z przedmiotu | | Sposób weryfikacji i oceny efektu | | |
| | [K6_U06] zdobywa nową wiedzę specjalistyczną związaną z kierunkiem studiów analityka gospodarcza planując własną strategię uczenia się przez całe życie | | zdobywa nową wiedzę niezbędną do doboru i zastosowania odpowiednich instrumentów zabezpieczających przed ryzykiem | | [SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi | | |
| | [K6_W03] zna wiarygodne źródła informacji i wykorzystuje zaawansowaną wiedzę do wyjaśniania fundamentalnych dylematów współczesnej gospodarki | | identyfikuje wiarygodne źródła pozyskiwania informacji do definiowania i analizy ryzyka | | [SW1] Ocena wiedzy faktograficznej | | |
| Treści przedmiotu | Pojęcie ryzyka, klasyfikacja i identyfikacja ryzyk. Proces zarządzania ryzykiem. Kalkulacja miar ryzyka (odchylenie standardowe, semiodchylenie standardowe, współczynnik zmienności, VAR). Kwantyfikacja ryzyka za pomocą: mapy ryzyka, metody Risk Score, stress testów. Ocena ryzyka za pomocą analizy scenariuszy oraz analizy wrażliwości. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem walutowym (forward, futures, opcje, swapy, korytarze zerokosztowe). Toksyczne produkty opcyjne. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem stopy procentowej (FRA, opcje, capy, floory, collary). Zabezpieczenie przed ryzykiem niewypłacalności. Pojęcie i rozliczanie transakcji CDS. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem pogodowym (forward, opcje, swapy, obligacje katastroficzne). | | | | | | |
| Wymagania wstępne i dodatkowe | Wiedza z zakresu zarządzania 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 | Benett, D. (2000). Ryzyko walutowe. Kraków: Dom Wydawniczy ABC. Jajuga, K. (red.). (2007 oraz 2019 wydanie II) Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWN. Kaczmarek, T.T. (2005). Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Warszawa: Difin. Kalinowski, M. (2009). Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu. Kalinowski, M. (2007). Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu. Karkowski, P. (2009). Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. Warszawa: GreenCapital.pl. Maliszewski, J. (2013). Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie. Warszawa: Wydawnictwo Linia. Preś, J. (2007). Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Warszawa: Cedewu. Tarczyński, W., Mojsiewicz, M. (2001). Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWE. Woźniak, J., Wereda, W. (red.). (2018). Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją. Warszawa: CeDeWu. | |
| | Uzupełniająca lista lektur | Best, P. (2000). Wartość narażona na ryzyko. Kraków: Dom Wydawniczy ABC. | |
| | Adresy eZasobów | Podstawowe https://www.researchgate.net/publication/286060552_Swapy_odmowy_zaplatty . - Swapy odmowy zapłaty. Uzupełniające Adresy na platformie eNauczanie: ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE - 2023/2024 - stac. - Moodle ID: 35108 https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=35108 | |
| Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania | Wymień i scharakteryzuj metody zabezpieczenia wewnętrznego przed ryzykiem kursowym. Wymień i scharakteryzuj instrumenty zewnętrzne zabezpieczające przed ryzykiem walutowym i stopy procentowej. Na podstawie określonych danych przedsiębiorstwa należy sporządzić mapę ryzyka. | | |
| Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu | Nie dotyczy | | |

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.