



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE, PG_00058609						
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	niestacjonarne	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)	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	16.0	0.0	0.0	0.0	16
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
	Zarządzanie ryzykiem- nstac. 2021/2022 - Nowy - Moodle ID: 20768 https://enauzanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=20768						
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	5.0		54.0		75
Cel przedmiotu	Identyfikuje ryzyka, na które narażone jest przedsiębiorstwo, dokonuje ich kwantyfikacji oraz doбира odpowiednie metody zabezpieczenia przed nimi.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K6_U06] zdobywa nową wiedzę planując strategię uczenia się przez całe życie		zdobycie nowej wiedzy niezbędnej do doboru i zastosowania odpowiednich instrumentów zabezpieczających przed ryzykiem		[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi		
	[K6_W03] identyfikuje wiarygodne źródła informacji istotne dla analizowanych zagadnień		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	Zarządzanie finansami przedsiębiorstw.						
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>Benett, D. (2000). Ryzyko walutowe. Kraków: Dom Wydawniczy ABC.</p> <p>Jajuga, K. (red.). (2007 oraz 2019 wydanie II) Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWN.</p> <p>Kaczmarek, T.T. (2005). Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Warszawa: Difin.</p> <p>Kalinowski, M. (2009). Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu.</p> <p>Kalinowski, M. (2007). Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu.</p> <p>Karkowski, P. (2009). Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. Warszawa: GreenCapital.pl.</p> <p>Maliszewski, J. (2013). Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie. Warszawa: Wydawnictwo Linia.</p> <p>Preś, J. (2007). Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Warszawa: Cedewu.</p> <p>Tarczyński, W., Mojsiewicz, M. (2001). Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWE.</p> <p>Woźniak, J., Wereda, W. (red.). (2018). Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją. Warszawa: CeDeWu.</p>
	Uzupełniająca lista lektur	Best, P. (2000). Wartość narażona na ryzyko. Kraków: Dom Wydawniczy ABC.
	Adresy eZasobów	<p>Podstawowe</p> <p>https://www.researchgate.net/publication/286060552_Swapy_odmowy_zaplaty - Swapy odmowy zapłaty.</p> <p>Uzupełniające</p> <p>https://www.ue.katowice.pl/fileadmin/user_upload/WFiU/katedry/kat-fin-przeds-i-ubezp-gosp/Publikacja_Cat_bonds.pdf - Błach, J., Wieczorek-Kosmala, M. (2014). Catastrophe Bonds as Innovative Tools of Corporate Financial Management Application and Limitations.</p> <p>https://docplayer.pl/60296596-Metody-identyfikacji-ryzyka-w-zarzadzaniu-ryzykiem-w-przedsiębiorstwie.html - Czajkowska, A. (2017). Metody identyfikacji ryzyka w zarządzaniu ryzykiem w przedsiębiorstwie. Journal of Modern Management Process, nr 1(2), s. 40-49.</p> <p>https://www.cmegroup.com/trading/weather/ - Weather Products.</p> <p>https://thedocs.worldbank.org/en/doc/737151585254940284-0340022020/original/FONDENMexicoCatBondCaseStudy3.4.2020final.pdf - Insuring Mexico against Natural Disasters.</p> <p>https://sbc.org.pl/dlibra/docmetadata?showContent=true&id=329985 - Pyka, I., Czech, M. (2018). Kontrakty CDS w roli nowoczesnego parametru oceny ryzyka kredytowego kraju. Studia Ekonomiczne. Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, nr 356, s. 124-145.</p> <p>http://wneiz.pl/nauka_wneiz/frfu/38-2011/FRFU-38-639.pdf - Blachowski, D. (2011). Ryzyko pogodowe i pogodowe instrumenty pochodne w przedsiębiorstwie energetycznym. Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego, Finanse, Rynki Finansowe, Ubezpieczenia, nr 640 (38), s. 639-648.</p>
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	<p>Wymień i scharakteryzuj metody zabezpieczenia wewnętrznego przed ryzykiem kursowym.</p> <p>Wymień i scharakteryzuj instrumenty zewnętrzne zabezpieczające przed ryzykiem walutowym i stopy procentowej.</p> <p>Na podstawie określonych danych przedsiębiorstwa należy sporządzić mapę ryzyka.</p>	
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy	