



Karta przedmiotu

|   |   |   |                       |   |  |                       |       |
|---|---|---|-----------------------|---|--|-----------------------|-------|
| Nazwa i kod przedmiotu  | ZARZĄDZANIE RYZYKIEM, PG_00066536   |   |                       |   |  |                       |       |
| Kierunek studiów  | Analityka gospodarcza   |   |                       |   |  |                       |       |
| Data rozpoczęcia studiów                                      | październik 2024 r.   | Rok akademicki realizacji przedmiotu  |                       |   | 2025/2026  |                       |       |
| Poziom kształcenia  | I stopnia - licencjackie  | Grupa zajęć   |                       |   | Grupa zajęć fakultatywnych<br>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   |                       |   | 4.0  |                       |       |
| 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   |   |                       |   |  |                       |       |
| Formy zajęć i metody nauczania                                | Forma zajęć   | Wykład  | Ćwiczenia             | Laboratorium  | Projekt  | Seminarium            | RAZEM |
|   | Liczba godzin zajęć   | 8.0   | 16.0                  | 0.0   | 0.0  | 0.0                   | 24    |
|   | 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  | 24  |                       | 5.0   |  | 71.0                  | 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_W03] zna wiarygodne źródła informacji i wykorzystuje zaawansowaną wiedzę do wyjaśniania fundamentalnych dylematów współczesnej gospodarki   | Student zna różne rodzaje ryzyk, które mogą mieć wpływ na działalność przedsiębiorstwa. Posiada wiedzę o metodach zabezpieczenia się przed tymi ryzykami.   |                       | [SW1] Ocena wiedzy faktograficznej                      |  |                       |       |
|   | [K6_U06] zdobywa nową wiedzę specjalistyczną związaną z kierunkiem studiów analityka gospodarcza planując własną strategię uczenia się przez całe życie   | Student zdobywa wiedzę dotyczącą zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie, w tym m.in. miar kalkulacji oraz metod kalkulacji ryzyka w przedsiębiorstwie i na podstawie pomiaru ryzyka potrafi wdrożyć odpowiednie działania ograniczające negatywne skutki ryzyk. |                       | [SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi |  |                       |       |
| Treści przedmiotu   | Pojęcie i rodzaje ryzyk. Kalkulacja miar ryzyka, tj. VAR, odchylenie oraz semiodchylenie standardowe, współczynnik oraz semiwspółczynnik zmienności. Tworzenie rejestru i mapy ryzyka. Metoda Risk Score. Ocena ryzyka za pomocą analizy scenariuszy oraz analizy wrażliwości. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem walutowym, stopy procentowej i pogodowym. |   |                       |   |  |                       |       |
| Wymagania wstępne i dodatkowe                                 | Zarządzanie finansami lub finanse przedsiębiorstw.  |   |                       |   |  |                       |       |
| Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się | Sposób oceniania (składowe)   |   | Próg zaliczeniowy     |   | Składowa oceny końcowej  |                       |       |
|   | Kolokwium   |   | 50.0%                 |   | 100.0%   |                       |       |

|   |   |   |
|---|---|---|
| Zalecana lista lektur   | Podstawowa lista lektur   | 1. Benett D.: Ryzyko walutowe. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000. 2. Błach, J., Wieczorek-Kosmała, M. (2014): Catastrophe Bonds as Innovative Tools of Corporate Financial Management Application and Limitations, <a href="https://www.ue.katowice.pl/fileadmin/user_upload/WFiU/katedry/kat-fin-przeds-i-ubezp-gosp/Publikacja_Cat_bonds.pdf">https://www.ue.katowice.pl/fileadmin/user_upload/WFiU/katedry/kat-fin-przeds-i-ubezp-gosp/Publikacja_Cat_bonds.pdf</a> (19.09.2024). 3. (red.) Jajuga K.: Zarządzanie ryzykiem. PWN, Warszawa 2007. 4. Kaczmarek T.T.: Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Difin, Warszawa 2005. 5. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2009. 6. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2007. 7. Maliszewski J.: Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie, Wydawnictwo Linia, Warszawa 2013. 8. Preś J.: Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Cedewu, Warszawa 2007. 9. Rudnicki R: (RMC), Konstruowanie mapy ryzyka, <a href="http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf">http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf</a> . 10. Tarczyński W., Mojsiewicz M.: Zarządzanie ryzykiem. PWE, Warszawa 2001. 11. Woźniak, J., Wereda, W. (red.): Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją, CeDeWu, Warszawa 2018 (rozdziały 5 i 6). |
|   | Uzupełniająca lista lektur  | 1. Best P. Wartość narażona na ryzyko. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000. 2. 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, <a href="http://wneiz.pl/nauka_wneiz/frfu/38-2011/FRFU-38-639.pdf">http://wneiz.pl/nauka_wneiz/frfu/38-2011/FRFU-38-639.pdf</a> (23.08.2023). 3. Czajkowska, A., Metody identyfikacji ryzyka w zarządzaniu ryzykiem w przedsiębiorstwie, Journal of Modern Management Process, nr 1(2)/2017, s. 40-49, <a href="https://docplayer.pl/60296596-Metody-identyfikacji-ryzyka-w-zarzadzaniu-ryzykiem-w-przedsiębiorstwie.html">https://docplayer.pl/60296596-Metody-identyfikacji-ryzyka-w-zarzadzaniu-ryzykiem-w-przedsiębiorstwie.html</a> (19.09.2024). 4. Sopoćko A.: Rynkowe instrumenty finansowe. Wydawnictwo Wyższej Szkoły przedsiębiorczości i Zarządzania im. Leona Koźmińskiego, Warszawa 2003, s. 188-218.  |
|   | Adresy eZasobów   | Adresy na platformie eNauczanie:  |
| Przykładowe zagadnienia/<br>przykładowe pytania/<br>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> |   |

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.