

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE, PG_00058536						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2023 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2024/2025		
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)	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						
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	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. Omówienie i zastosowanie swapów na wypadek niewypłacalności (CDS).						
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-Kosmala, M. (2014): 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 (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. Karkowski P.: Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. GreenCapital.pl, Warszawa 2009. 8. Maliszewski J.: Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie, Wydawnictwo Linia, Warszawa 2013. 9. Preś J.: Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Cedewu, Warszawa 2007. 10. Rudnicki R. (RMC), Konstruowanie mapy ryzyka, http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf. 11. Szmelter, M.: Swapy kredytowe, Wydawnictwo Uniwersytetu Gdańskiego, Gdańsk 2021. 12. Tarczyński W., Mojsiewicz M.: Zarządzanie ryzykiem. PWE, Warszawa 2001. 13. 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, http://wneiz.pl/nauka_wneiz/frfu/38-2011/FRFU-38-639.pdf (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, https://docplayer.pl/60296596-Metody-identyfikacji-ryzyka-w-zarzadzaniu-ryzykiem-w-przedsiębiorstwie.html (19.09.2024). 4. 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/docmetadata?showContent=true&id=329985 (19.09.2024). 5. 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: ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE - 2024/2025 - stac. - Moodle ID: 42861 https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=42861

Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Zad. 1 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. Zad. 2 Przedsiębiorstwo jest zarazem importerm 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. Korzystając z poniższych informacji przeprowadź kalkulację z wykorzystaniem swapa, przy założeniu dwóch wariantów kursu USD/PLN za miesiąc. Informacje: Nominał: 100 000 USD Kurs spot na dzień 10.09.2008: 2,4535/2,4565 Kurs terminowy: 2,4585/2,4615 Pytania: 1) Wymień metody zabezpieczenia wewnętrznego przed ryzykiem kursowym. 2) Wymień i scharakteryzuj instrumenty zewnętrzne zabezpieczające przed ryzykiem walutowym.
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.