



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE, PG_00058609						
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	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)	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	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	5.0		54.0		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_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	
[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		
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	<p>1. Benett D.: Ryzyko walutowe. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000.</p> <p>2. Błach, J., Wieczorek-Kosmała, 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).</p> <p>3. (red.) Jajuga K.: Zarządzanie ryzykiem. PWN, Warszawa 2007.</p> <p>4. Kaczmarek T.T.: Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Difin, Warszawa 2005.</p> <p>5. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2009.</p> <p>6. Kalinowski M.: Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. CeDeWu, Warszawa 2007.</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. Rudnicki R. (RMC), Konstruowanie mapy ryzyka, http://www.rudnicki.com.pl/pub/RM_05.pdf.</p> <p>10. Tarczyński W., Mojsiewicz M.: Zarządzanie ryzykiem. PWE, Warszawa 2001.</p> <p>11. Woźniak, J., Wereda, W. (red.): Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją, CeDeWu, Warszawa 2018 (rozdziały 5 i 6).</p>
	Uzupełniająca lista lektur	<p>1. Best P. Wartość narażona na ryzyko. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000.</p> <p>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).</p> <p>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).</p> <p>4. Sopoćko A.: Rynkowe instrumenty finansowe. Wydawnictwo Wyższej Szkoły przedsiębiorczości i Zarządzania im. Leona Koźmińskiego, Warszawa 2003, s. 188-218.</p>
	Adresy eZasobów	<p>Adresy na platformie eNauczanie:</p> <p>ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE - 2024/2025 - nstac. - Moodle ID: 42886</p> <p>https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=42886</p>

Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ 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>
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.