



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W PRZEDSIĘBIORSTWIE, PG_00071131						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2026 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2028/2029		
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	3		Język wykładowy		polski		
Semestr studiów	5		Liczba punktów ECTS		4.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		egzamin		
Jednostka prowadząca	Wydziały Politechniki Gdańskiej -> Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr hab. Błażej Prusak				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	30.0	0.0	0.0	0.0	45
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
	Adres kursu na platformie eNauczanie: https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=47320						
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	45		3.0		52.0	100
Cel przedmiotu	przygotowanie studentów do identyfikacji oraz kwantyfikacji ryzyk występujących w przedsiębiorstwie i doboru instrumentów zabezpieczających, w oparciu o wiedzę dotyczącą metod analizy ryzyka, źródeł informacji oraz narzędzi finansowych.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu			Sposób weryfikacji i oceny efektu	
	[K6_U04] potrafi opracowywać logiczne rozwiązania złożonych lub nieustrukturyzowanych problemów, nawet w warunkach niepewności.		potrafi rozwiązywać złożone i nieustrukturyzowane problemy związane z zarządzaniem ryzykiem w przedsiębiorstwie, także w warunkach niepewności, dobierając adekwatne metody identyfikacji, analizy i oceny ryzyka.			[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi	
	[K6_K02] jest gotów do podejmowania kompetentnych i etycznych decyzji w celu tworzenia i utrzymania wartości ekonomicznych, społecznych i środowiskowych, wykazując się działaniami przedsiębiorczymi.		jest gotów do podejmowania świadomych i odpowiedzialnych decyzji w obszarze zarządzania ryzykiem, uwzględniając ich wpływ na wyniki ekonomiczne, aspekty społeczne i środowiskowe oraz inicjując działania ograniczające ryzyko.			[SK2] Ocena postępów pracy [SK5] Ocena umiejętności rozwiązywania problemów występujących w praktyce	
	[K6_W03] zna wiarygodne źródła informacji i wykorzystuje zaawansowaną wiedzę do wyjaśniania fundamentalnych dylematów współczesnej gospodarki.		zna i rozumie rodzaje oraz klasyfikacje ryzyk, metody ich identyfikacji, a także metody zabezpieczania się przed różnymi typami ryzyk			[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej	

Treści przedmiotu	Treści przedmiotu - wykład 1. Pojęcie ryzyka, klasyfikacja i identyfikacja ryzyk. 2. Proces zarządzania ryzykiem. Pojęcie i zastosowanie ROM 3. Kalkulacja miar ryzyka (odchylenie standardowe, semiodchylenie standardowe, współczynnik zmienności, semiwspółczynnik zmienności, VAR, CVAR). 4. Analiza wrażliwości, scenariuszy i Monte Carlo w ocenie ryzyka. 5. Kwantyfikacja ryzyka za pomocą: mapy ryzyka, metody Risk Score, stress testów. 6. Pojęcie i zastosowanie miernika ROM (return on mitigation). 7. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem walutowym (forward, futures, opcje, swapy, korytarze zerokosztowe). 8. Toksyczne produkty opcyjne. 9. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem stopy procentowej (FRA, opcje, capy, floory, swapy, collary). 10. Zabezpieczenie przed ryzykiem niewypłacalności. Pojęcie i rozliczanie transakcji CDS. 11. Rodzaje i charakterystyka ryzyk pogodowych. 12. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem pogodowym (forward, opcje, swapy, obligacje katastroficzne). Treści przedmiotu - ćwiczenia 1. Pojęcie ryzyka, klasyfikacja i identyfikacja ryzyk. 2. Proces zarządzania ryzykiem. 3. Kalkulacja miar ryzyka (odchylenie standardowe, semiodchylenie standardowe, współczynnik zmienności, semiwspółczynnik zmienności, VAR, CVAR). 4. Kwantyfikacja ryzyka za pomocą: mapy ryzyka, metody Risk Score, stress testów. 5. Analiza wrażliwości, scenariuszy i Monte Carlo w ocenie ryzyka. 6. Pojęcie i zastosowanie miernika ROM (return on mitigation). 7. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem walutowym (forward, futures, opcje, swapy, korytarze zerokosztowe). 8. Toksyczne produkty opcyjne. 9. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem stopy procentowej (FRA, opcje, capy, floory, swaps, collary). 10. Zabezpieczenie przed ryzykiem niewypłacalności. Pojęcie i rozliczanie transakcji CDS. 11. Rodzaje i charakterystyka ryzyk pogodowych. 12. Zastosowanie transakcji zabezpieczających przed ryzykiem pogodowym (forward, opcje, swapy, obligacje katastroficzne).		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Zarządzanie finansami.		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Kolokwium 1 i 2	60.0%	90.0%
	Aktywność na zajęciach	0.0%	10.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	1. Benett, D.(2000). Ryzyko walutowe. Kraków: Dom Wydawniczy ABC. 2. Jajuga, K. (red.). (2007 oraz 2019 wydanie II) Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWN. 3. Kaczmarek, T.T. (2005). Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Warszawa: Difin. 4. Kalinowski, M. (2009). Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu. 5. Kalinowski, M. (2007). Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie. Warszawa: CeDeWu. 6. Karkowski, P. (2009). Toksyczne opcje. Od zaufania do bankructwa. Warszawa: GreenCapital.pl 7. Maliszewski, J. (2013). Zarządzanie ryzykiem kursu walutowego w przedsiębiorstwie. Warszawa: Wydawnictwo Linia. 8. Preś, J. (2007). Zarządzanie ryzykiem pogodowym. Warszawa: Cedewu. 9. Tarczyński, W., Mojsiewicz, M. (2001). Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: PWE. 10. Thompson, C., Hopkin, P. (2024). Podstawy zarządzania ryzykiem. Jak wdrażać efektywne systemy zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie, Wydanie VI. Gliwice: Helion 11. Woźniak, J., Wereda, W. (red.). (2018). Mapa ryzyka w zarządzaniu organizacją. Warszawa: CeDeWu.	
	Uzupełniająca lista lektur	1. Best, P. (2000). Wartość narażona na ryzyko. Kraków: Dom Wydawniczy ABC. 2. Hubbard, D.W. (2020). The Failure of Risk Management. Why Iss Broken and How to Fix It, Wiley, Second Edition, New Yersey, s. 73-75, 142-150.	
	Adresy eZasobów		
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.		
Zajęcia praktyczne w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.