


KAPITAŁ LUDZKI
NARODOWA STRATEGIA SPÓJNOŚCI

Projekt współfinansowany przez
Unię Europejską w ramach
Europejskiego Funduszu
Społecznego

UNIA EUROPEJSKA
EUROPEJSKI
FUNDUSZ SPOŁECZNY


Nazwa przedmiotu		Kod ECTS	
Zarządzanie ryzykiem		4.0.3408	
Nazwa jednostki prowadzącej przedmiot			
Katedra Bankowości i Finansów			
Studia			
wydział	kierunek	poziom	drugiego stopnia
Wydział Zarządzania	Finanse i rachunkowość	forma	stacjonarne
		moduł specjalnościowy	finanse przedsiębiorstw i controlling, rachunkowość
		specjalizacja	wszystkie
Nazwisko osoby prowadzącej (osób prowadzących)			
dr Błażej Lepczyński; dr Adam Barembruch; dr Mariusz Chmielewski; dr Jędrzej Siciński; dr Małgorzata Siemionek-Ruskań; dr Sławomir Kujawa			
Formy zajęć, sposób ich realizacji i przypisana im liczba godzin		Liczba punktów ECTS	
Formy zajęć		4	
Wykład, Ćw. audytoryjne		0,60 pkt ECTS (15 h) - Udział w wykładach	
Sposób realizacji zajęć		0,60 pkt ECTS (15 h) - Udział w ćwiczeniach	
zajęcia on-line, zajęcia w sali dydaktycznej		1,20 pkt ECTS (30 h) - Studiowanie literatury przedmiotu	
Liczba godzin		0,80 pkt ECTS (20 h) - Przygotowanie projektu	
Ćw. audytoryjne: 15 godz., Wykład: 15 godz.		0,80 pkt ECTS (20 h) - Przygotowanie do zaliczenia	
Termin realizacji przedmiotu			
2024/2025 letni			
Status przedmiotu	Język wykładowy		
obowiązkowy	polski		
Metody dydaktyczne	Forma i sposób zaliczenia oraz podstawowe kryteria oceny lub wymagania egzaminacyjne		
	Sposób zaliczenia		
	- Zaliczenie na ocenę		
	- Egzamin		
- Dyskusja oraz praca na zajęciach (projekt); Kolokwium - Egzamin - wykład	Formy zaliczenia		
	- wykonanie pracy zaliczeniowej - projekt lub prezentacja		
	- egzamin pisemny testowy		
	- kolokwium		
	Podstawowe kryteria oceny		
	Wykład: Ocena z egzaminu polegająca na rozwiązaniu co najmniej połowy plus jedno pytanie z testu.		
	Ćwiczenia: Projekt / kolokwium (pytania otwarte, testowe oraz zadania)		
Sposób weryfikacji założonych efektów uczenia się			

	Ćwiczenia	Wykład
	Projekt i /lub zaliczenie pisemne	Zaliczenie pisemne
Wiedza	Wiedza	Wiedza
FiR2 W02		X
FiR2 W07	X	X
FiR2 W08	X	X
Umiejętności	Umiejętności	Umiejętności
FiR2 U01	X	X
FiR2 U03	X	X
FiR2 U06	X	X
Kompetencje	Kompetencje	Kompetencje
FiR2 K04	X	X
FiR2 K05	X	
FiR2 K06	X	

Określenie przedmiotów wprowadzających wraz z wymogami wstępnymi**A. Wymagania formalne**

Brak

B. Wymagania wstępne

Znajomość podstawowych pojęć z zakresu finansów, finansów przedsiębiorstw i bankowości

Cele kształcenia

- Poznanie metod identyfikacji ryzyka
- Nabycie umiejętności rozpoznania źródeł ryzyka
- Zapoznanie się z metodami oceny ryzyka w ujęciu ilościowym i jakościowym
- Zdobycie wiedzy dotyczącej integrowania systemu zarządzania ryzykiem i umiejętności posługiwania się poznanymi metodami w tworzeniu polityki, planu i strategii ryzyka oraz zastosowania do nich odpowiednich narzędzi.

Treści programowe

- 1)Wprowadzenie do ryzyka i zarządzania ryzykiem – rodzaje ryzyka, sposoby pomiaru ryzyka i narzędzia stosowane w analizie ryzyka
- 2)Integrowany system zarządzania ryzykiem i jego cechy (ERM)
- 3)Zarządzanie ryzykiem w instytucji finansowej – przykład banku
- 4)Zarządzenie ryzykiem kredytowym
- 5)Zarządzanie ryzykiem rynkowym
- 6)Zarządzanie ryzykiem operacyjnym
- 7)Zarządzanie ryzykiem płynności
- 8)Rola regulacji w zarządzaniu ryzykiem
- 9)Zarządzanie ryzykiem ESG (ryzyko klimatyczne w instytucjach finansowych)
- 10)Cyberzagrożenia i ryzyko geopolityczne – wpływ na współczesne przedsiębiorstwa

Wykaz literatury**Literatura podstawowa**

Zarządzanie ryzykiem, Przegląd wybranych metodyk, red. nauk. D. Wróblewski, Wydawnictwo CNBOP-PIB, Józefów, 2015 r.
 Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych, J. C. Hull, PWN, Warszawa 2021.
 Zarządzanie ryzykiem, red. K. Jajuga, PWN, Warszawa 2018.
 Ryzyko instytucji finansowych - współczesne trendy i wyzwania, red. T. Czerwińska, K. Jajuga, CH Beck, Warszawa 2016.

Literatura uzupełniająca:

J. Lam, Enterprise Risk Management, Wiley, 2014.

J. Zawila-Niedźwiecki, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym w zapewnianiu ciągłości działania organizacji, edu-Libri, 2021.

Kierunkowe efekty uczenia się**Wiedza Efekt uczenia się**

FIR2_W02 Ma zaawansowaną i uporządkowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących,

FIR2_W07 Zna zasady oceny przedsięwzięć w zakresie finansów i rachunkowości (opłacalności projektów inwestycyjnych, oceny sytuacji finansowej organizacji, oceny ryzyka, zagrożenia upadłością)

FIR2_W08 Ma pogłębioną wiedzę na temat tworzenia i ekonomicznego funkcjonowania organizacji komercyjnych i sektora publicznego, ich form, faz rozwoju, jak również uwarunkowań finansowych determinujących ich wartość oraz sukces ekonomiczny

Umiejętności Efekt uczenia się

FIR2_U01 Rozumie i potrafi prawidłowo interpretować złożone zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości oraz podstawowe w zakresie pozostałych nauk społecznych

FIR2_U03 Potrafi właściwie analizować przyczyny i przebieg i skutki procesów i zjawisk w zakresie finansów i rachunkowości z wykorzystaniem właściwych metod nauk ekonomicznych. Umie zweryfikować proste hipotezy badawcze.

FIR2_U06 Wykorzystuje zdobytą wiedzę w sposób kreatywny w różnych zakresach i formach do rozwiązywania problemów z zakresu finansów i rachunkowości pojawiających się w praktyce gospodarczej.

Kompetencje Efekt uczenia się

FIR2_K04 Uczciwość

FIR2_K05 Odpowiedzialność

FIR2_K06 Kreatywność

Wiedza

Zna pojęcia związane z analizą i zarządzaniem ryzykiem

Zna zasady szacowania stopy zwrotu i ryzyka pojedynczego papieru i portfela papierów wartościowych

Zna metody i narzędzia, w tym techniki identyfikacji i analizy ryzyka

Zna ogólnodostępne źródła informacji dotyczące ryzyka

Umiejętności

Umie wykorzystać w praktyce podstawową wiedzę z zakresu zarządzania ryzykiem
Rozumie i potrafi prawidłowo oszacować i zinterpretować wybrane miary dotyczące stopy zwrotu i ryzyka.

Potrafi pozyskiwać dane do analizy ryzyka

Potrafi oszacować i interpretować wybrane miary ryzyka w tym wartość narażoną na ryzyko oraz adjustowane ryzykiem stopy zwrotu

Kompetencje społeczne (postawy)

Potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę i umiejętności

Potrafi harmonijnie współdziałać i pracować w grupie, przyjmując w niej różne role

Potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie

Myśli kreatywnie, potrafi wyjść poza utarte schematy

Potrafi elastycznie dostosować się do wymogów otoczenia

Reaguje na próby manipulowania danymi ekonomicznymi

Kontakt

blazej.peczynski@ug.edu.pl