

Nazwa kierunku studiów:

Finanse i Rachunkowość

Nazwa przedmiotu: Zarządzanie ryzykiem

Poziom studiów: I stopnia

Forma studiów: Niestacjonarne

Profil studiów: ogólnoakademicki

Nazwa przedmiotu: Zarządzanie ryzykiem

Forma zajęć i punkty ECTS

	Liczba godzin	Punkty ECTS	Sposób zaliczenia
wykłady	16		egzamin
Razem	16	5	

Cele kształcenia

Przedmiot ma zapoznać studenta z:

- podstawami oceny i pomiaru ryzyka;
- elementami matematyki finansowej przy ocenie instrumentów finansowych służących zarządzaniu ryzykiem (wybrane rodzaje instrumentów pochodnych);
- metodami opracowania i prezentowania danych ekonometrycznych w procesie zarządzania ryzykiem.

Znajomość zasad oceny ryzyka inwestycji – w tym podstawowe pojęcia dla tego materiału i zakresu obejmujące: statystyczne wyznaczanie wysokości ryzyka, pomiar ryzyka rynkowego (systematycznego), krótka sprzedaż – jako alternatywa ograniczania ryzyka spadku ceny instrumentu finansowego. Dodatkowymi aspektami są sposoby zarządzania ryzykiem w wybranych instytucjach w tym w banku, w towarzystwie ubezpieczeniowym czy zarządzanie ryzykiem krajów. Posługiwanie się instrumentami pochodnymi, które są istotnymi instrumentami zarządzania ryzykiem, wymaga przede wszystkim bliższej znajomości ich istoty i funkcji oraz zasad obrotu nimi. Tym właśnie zagadnieniom poświęcony jest przedmiot w ramach którego charakteryzuje się najczęściej występujące instrumenty pochodne takie jak kontrakty terminowe, kontrakty opcyjne czy swapy.

Efekty uczenia się

Kategoria: WIEDZA		
SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	OPIS EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO
P_W1	W1-Ma podstawową wiedzę na temat istoty rynku instrumentów pochodnych, ich funkcji oraz roli w procesie zarządzania ryzykiem;	FiR_WG04_Lic FiR_WG05_Lic FiR_WG15_Lic FiR_WG18_Lic FiR_WK02_Lic
Kategoria: UMIEJĘTNOŚCI		
SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	OPIS EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO
P_U1	U1-Rozumie zasady funkcjonowania rynku instrumentów pochodnych i zasad obrotu nimi	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic
P_U2	U2-Rozumie zasady wyceny instrumentów pochodnych i tych funkcjonujących na rynku giełdowym i pozagiełdowym;	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic
P_U3	U3-Rozumie istotę zarządzania ryzykiem w wybranych instytucjach finansowych (banki, firmy ubezpieczeniowe, fundusze inwestycyjne) czy też instytucjach niefinansowych (osoby prawne i fizyczne)	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic
Kategoria: KOMPETENCJE SPOŁECZNE		
SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	OPIS EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO
P_K1	K1-Potrafi formułować podstawowe opinie w sprawach dotyczących wykorzystania instrumentów pochodnych dla podmiotu gospodarczego w praktyce oraz ich wpływu na kształtowanie się wyniku finansowego podmiotu;	FiR_KK02_Lic FiR_KO04_Lic FiR_KR02_Lic

Treści programowe przedmiotu

NUMER	OPIS ZAGADNIENIA	FORMA ZAJĘĆ	LICZBA GODZIN
1	Ryzyko inwestycji – podstawowe pojęcia Określenie i definicja ryzyka inwestycji. Rodzaje ryzyka inwestycji i określenie warunków szczególnych dla każdego rodzaju ryzyka.	wykłady	2 / 2
2	Statystyczne wyznaczanie wysokości ryzyka – 3 godziny (0,5) Teoretyczne podstawy pomiaru ryzyka. Miary ryzyka wynikające z rozkładu statystycznego zmiennej ryzyka. Miary zmienności. Kwantyle rozkładu. Wartości dystrybuanty rozkładu. Koncepcja miar wrażliwości. Miary zmienności.	wykłady	2 / 2
3	Kontrakty terminowe - charakterystyka, zasady obrotu, sposób wyceny i zastosowanie do hedgingu, arbitrażu i do spekulacji.	wykłady	4 / 4
4	Opcje - charakterystyka, zasady obrotu - zastosowanie do arbitrażu, spekulacji oraz do zarządzania ryzykiem.	wykłady	4 / 4
5	Opcje - sposoby wyceny, alfabet grecki dla współczynników kształtujących wycenę opcji	wykłady	2 / 2
6	swapy - charakterystyka, zasady obrotu i sposoby wyceny	wykłady	2 / 2

Warunki zaliczenia

WYKŁADY

FORMA ZALICZENIA	WAGA FORMY ZALICZENIA
Egzamin	100

Metody kształcenia

- analiza przypadków i przykładów
- analiza przypadków i przykładów
- Wykład multimedialny
- wykłady
- multimedialna prezentacja wyników badań
- Wykład akademicki
- - wykład
- multimedialna prezentacja wyników badań
- - wykład

Literatura przedmiotu (obowiązkowa)

- Jajuga Krzysztof. Zarządzanie Ryzykiem 2018
- Hull J.C. . Opcje i kontrakty futures - wprowadzenie 2003
- Tarczyński, Mojsiewicz. zarządzanie ryzykiem 2001

Literatura przedmiotu (uzupełniająca)

- Jajuga Krysztof, Jajuga Teresa. Inwestycje 2015

Odniesienie efektów przedmiotowych do efektów kierunkowych, treści kształcenia, metod weryfikacji

SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO TREŚCI KSZTAŁCENIA (NAUCZANIA)	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO METODY WERYFIKACJI
WIEDZA			
P_W1	FiR_WG04_Lic FiR_WG05_Lic FiR_WG15_Lic FiR_WG18_Lic FiR_WK02_Lic	1 2 3 4 5 6	aktywność na wykładach Egzamin
SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO TREŚCI KSZTAŁCENIA (NAUCZANIA)	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO METODY WERYFIKACJI
UMIEJĘTNOŚCI			
P_U1	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic	1 2 3 4 5 6	aktywność na wykładach Egzamin
P_U2	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic	1 2 3 4 5 6	aktywność na wykładach Egzamin
P_U3	FiR_UW01_Lic FiR_UW04_Lic FiR_UK01_Lic FiR_UU01_Lic FiR_UU02_Lic	1 2 3 4 5 6	aktywność na wykładach Egzamin
SYMBOL EFEKTU UCZENIA SIĘ	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO EFEKTU KIERUNKOWEGO	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO TREŚCI KSZTAŁCENIA (NAUCZANIA)	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO METODY WERYFIKACJI
KOMPETENCJE SPOŁECZNE			
P_K1	FiR_KK02_Lic FiR_KO04_Lic FiR_KR02_Lic	1 2 3 4 5 6	aktywność na wykładach Aktywny udział w dyskusjach. analiza przykładów i przypadków