

WYDZIAŁ Informatyki i Zarządzania

**KARTA PRZEDMIOTU****Nazwa w języku polskim** Zarządzanie ryzykiem**Nazwa w języku angielskim** Risk Management**Kierunek studiów (jeśli dotyczy):** Zarządzanie**Specjalność (jeśli dotyczy):** Zarządzanie finansami (ZF)**Stopień studiów i forma:** II stopień/ stacjonarna**Rodzaj przedmiotu:** obowiązkowy**Kod przedmiotu** FBZ1180**Grupa kursów** NIE

|   | Wykład              | Ćwiczenia | Laboratorium | Projekt | Seminarium          |
|---|---------------------|-----------|--------------|---------|---------------------|
| Liczba godzin zajęć zorganizowanych w Uczelni (ZZU)                                       | 15                  |           |              |         | 15                  |
| Liczba godzin całkowitego nakładu pracy studenta (CNPS)                                   | 30                  |           |              |         | 60                  |
| Forma zaliczenia  | Zaliczenie na ocenę |           |              |         | Zaliczenie na ocenę |
| Dla grupy kursów zaznaczyć kurs końcowy (X)   |                     |           |              |         |                     |
| Liczba punktów ECTS   | 1                   |           |              |         | 2                   |
| w tym liczba punktów odpowiadająca zajęciom o charakterze praktycznym (P)                 |                     |           |              |         | 2                   |
| w tym liczba punktów ECTS odpowiadająca zajęciom wymagającym bezpośredniego kontaktu (BK) | 0,5                 |           |              |         | 0,5                 |

\*niepotrzebne skreślić

**WYMAGANIA WSTĘPNE W ZAKRESIE WIEDZY, UMIEJĘTNOŚCI I INNYCH KOMPETENCJI**

1. Znajomość podstawowych metod zarządzania organizacjami
2. Znajomość pojęcia ryzyka i konieczności jego redukcji
3. Wiedza o zmiennym otoczeniu organizacji

**CELE PRZEDMIOTU**

- C1 Poznanie źródeł wewnętrznych i zewnętrznych ryzyka działalności organizacji  
 C2 Poznanie metod zarządzania ryzykiem

### PRZEDMIOTOWE EFEKTY KSZTAŁCENIA

Z zakresu wiedzy:

PEK\_W01 - Rozumie źródła ryzyka w przedsiębiorstwie

PEK\_W02 - Zna narzędzia zarządzania ryzykiem w działalności przedsiębiorstw, banków, instytucji ubezpieczeniowych

PEK\_W03 - Posiada wiedzę w zakresie pochodnych instrumentów finansowych

Z zakresu umiejętności:

PEK\_U01 - Potrafi i oceniać ryzyko inwestycji finansowych

PEK\_U02 - Potrafi stosować miary ryzyka i narzędzia zarządzania ryzykiem

Z zakresu kompetencji społecznych:

PEK\_K01 - ma świadomość znaczenia i metod pomiaru ryzyka, strategii zarządzania ryzykiem

### TREŚCI PROGRAMOWE

| Forma zajęć - wykład |   | Liczba godzin |
|----------------------|---|---------------|
| Wy1                  | Wprowadzenie – cele i funkcje zarządzania ryzykiem              | 2             |
| Wy2                  | Źródła ryzyka w działalności organizacji                        | 2             |
| Wy3                  | Rodzaje ryzyka i zarządzania nim (model FERMA)                  | 2             |
| Wy4                  | Metody zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie; dywersyfikacja | 2             |
| Wy5                  | Metody zarządzania ryzykiem w banku (ryzyko kredytowe)          | 2             |
| Wy6.                 | Metody zarządzania ryzykiem w instytucji ubezpieczeniowej       | 2             |
| Wy7                  | Instrumenty pochodne w zarządzaniu ryzykiem                     | 2             |
| Wy8                  | Sprawdzian  | 1             |
|                      | Suma godzin   | <b>15</b>     |

| Forma zajęć - ćwiczenia |  | Liczba godzin |
|-------------------------|--|---------------|
| Ćw1                     |  |               |
| Ćw2                     |  |               |
| Ćw3                     |  |               |
|                         |  |               |

| Forma zajęć - laboratorium |             | Liczba godzin |
|----------------------------|-------------|---------------|
| La1                        |             |               |
| La2                        |             |               |
| La3                        |             |               |
|                            | Suma godzin |               |

| Forma zajęć - projekt |             | Liczba godzin |
|-----------------------|-------------|---------------|
| Pr1                   |             |               |
| Pr2                   |             |               |
| Pr3                   |             |               |
|                       | Suma godzin |               |

| Forma zajęć - seminarium |                                | Liczba godzin |
|--------------------------|--------------------------------|---------------|
| Se1                      | Wprowadzenie i omówienie zadań | 2             |

|     |   |           |
|-----|---|-----------|
| Se2 | Metoda dywersyfikacji ryzyka – portfel działalności | 2         |
| Se3 | Metoda VaR w szacowaniu ryzyka                      | 2         |
| Se4 | Budowa portfela kredytowego                         | 2         |
| Se5 | Przykłady rachunku aktuarialnego                    | 2         |
| Se6 | Metoda mapowania ryzyka                             | 2         |
| Se7 | Metoda listowania ryzyka                            | 2         |
| 8   | Sprawdzian  | 1         |
|     | <b>Suma godzin</b>                                  | <b>15</b> |

| <b>STOSOWANE NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE</b>                                |
|---|
| N1.Wykład multimedialny<br>N2.Rozwiązywanie problemów<br>N3.Ćwiczenia |

### **OCENA OSIĄGNIĘCIA PRZEDMIOTOWYCH EFEKTÓW KSZTAŁCENIA**

| <b>Oceny</b> (F – formująca<br>(w trakcie semestru), P<br>– podsumowująca (na<br>koniec semestru)) | Numer efektu<br>kształcenia                        | Sposób oceny osiągnięcia efektu kształcenia |
|--|--|---|
| P1   | PEK_W01 ÷ PEK_W03,<br>PEK_U01, PEK_U01,<br>PEK_K01 | Sprawdzian pisemny                          |
| S1   | PEK_W01 ÷ PEK_W03,<br>PEK_U01, PEK_U01,<br>PEK_K01 | Wystąpienie podczas seminarium              |
|  |  |   |
| P=1  |  |   |

| <b>LITERATURA PODSTAWOWA I UZUPEŁNIAJĄCA</b>  |
|---|
| <p>[1] RYZYKO i niepewność w zarządzaniu firmą / Marian Krupa. - Kraków ; Kluczbork : Antykwa, 2002</p> <p>[2] RYZYKO ekonomiczne w działalności gospodarczej / Sławomir Nahotko. - Wyd. 2 zm. i uzup. - Bydgoszcz : Oficyna Wydawnicza Ośrodka Postępu Organizacyjnego, 2001 RYZYKO działalności inwestycyjnej przedsiębiorstw / Alfreda Zachorowska. - Warszawa : Polskie Wydaw. Ekonomiczne, 2006.</p> <p>[3] POMIAR ryzyka kredytowego banku : aspekty finansowe i rachunkowe / Radosław Kałużny. - Warszawa : Wydaw. Naukowe PWN, 2009.</p> <p>[4] RACJONALNOŚĆ decyzji : pewność i ryzyko / Tadeusz Tyszk, Tomasz Zaleśkiewicz. - Warszawa : Polskie Wydaw. Ekonomiczne, 2001</p> <p>[5] RYZYKO projektów inwestycyjnych / Elżbieta Ostrowska. - Warszawa : Polskie Wydaw. Ekonomiczne, 2002.</p> <p>[6] Skoring w zarządzaniu ryzykiem.- Kraków : StatSoft Polska, 2010.</p> <p>[7] SZTUKA inwestowania : analiza techniczna, strategie inwestycyjne i zarządzanie ryzykiem na GPW / Paweł Perz. - Warszawa : K.E. Liber, 2008. -</p> <p>[8] TAJNIKI Value at Risk : praktyczny podręcznik zastosowań metody VaR / Cormac Butler ; tł. z ang. Tymoteusz Doligalski. - Warszawa : K.E. Liber, 2001.</p> <p>[9] Ubezpieczenia w zarządzaniu ryzykiem przedsiębiorstwa. T. 1, Podstawy / pod red. Bogusława Hadyniaka i Jana Monkiewicza.- Warszawa : Wydawnictwo Poltext, cop. 2010.</p> |

- [10] Ubezpieczenia w zarządzaniu ryzykiem przedsiębiorstwa. T. 2, Zastosowania / pod red. Lecha Gąsiorkiewicza i Jana Monkiewicza.- Warszawa : Wydawnictwo Poltext, cop. 2010.
- [11] ZARZĄDZANIE ryzykiem finansowym w bankach : teoria i praktyka zarządzania aktywami i pasywami / Dennis G. Uyemura, Donald R. van Deventer. - Warszawa : Związek Banków Polskich, 1997.
- [12] WILIMOWSKA Z., WILIMOWSKI M., Sztuka zarządzanie finansami., Bydgoszcz, TNOiK OPO, 2001
- [13] LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:
- [14] ZARZĄDZANIE ryzykiem w przedsięwzięciach inwestycyjnych : ryzyko walutowe i ryzyko stopy procentowej / Waldemar Rogowski, Andrzej Michalczewski. - Kraków :
- [15] RYZYKO finansowe : metody identyfikacji i zarządzania ryzykiem finansowym / John Holliwell; tł. z ang. Przemysław Lach. - Warszawa : K.E. Liber, 2001Oficyna Ekonomiczna, Oddział Polskich Wydawnictw Profesjonalnych, 2005
- [16] UBEZPIECZENIA : rynek i ryzyko : praca zbiorowa / red. Wanda Ronka-Chmielowiec; Krzysztof Jajuga [et al.]. - Warszawa : Polskie Wydaw. Ekonomiczne, 2002.
- [17]

**OPIEKUN PRZEDMIOTU (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL)**

**Zofia Wilimowska, zofia.wilimowska@pwr.wroc.pl**

**MACIERZ POWIĄZANIA EFEKTÓW KSZTAŁCENIA DLA PRZEDMIOTU**  
**Zarządzanie ryzykiem**  
**Z EFEKTAMI KSZTAŁCENIA NA KIERUNKU Zarządzanie**  
**I SPECJALNOŚCI Zarządzanie finansami (ZF)**

| <b>Przedmiotowy efekt kształcenia</b> | <b>Odniesienie przedmiotowego efektu do efektów kształcenia zdefiniowanych dla kierunku studiów i specjalności (o ile dotyczy)**</b> | <b>Cele przedmiotu***</b> | <b>Treści programowe***</b> | <b>Numer narzędzia dydaktycznego***</b> |
|---------------------------------------|--|---------------------------|-----------------------------|---|
| <b>PEK_W01 (wiedza)</b>               | S2_IZF_W06   | C1                        | W1,<br>Se1÷Se7              | N1, N2, N3                              |
| <b>PEK_W02 (wiedza)</b>               | S2_IZF_W06<br>S2_IZF_W04   | C1, C2                    | Wy2÷Wy6,<br>Se1÷Se7         | N1, N2, N3                              |
| <b>PEK_W03 (wiedza)</b>               | S2_IZF_W06   | C1, C2                    | Wy7,<br>Se1÷Se7             | N1, N2                                  |
| <b>PEK_U01 (umiejętności)</b>         | S2_IZF_U06   | C1                        | Wy1÷Wy7,<br>Se1÷Se7         | N1, N2, N3                              |
| <b>PEK_U02 (umiejętności)</b>         | S2_IZF_U06   | C1, C2                    | Wy1÷Wy7,<br>Se1÷Se7         | N1, N2, N3                              |
| <b>PEK_K01 (kompetencje)</b>          | K2_ZARZ_K05  | C1, C2                    | Wy1÷Wy7,<br>Se1÷Se7         | N1, N2, N3                              |

\*\* - wpisać symbole kierunkowych/specjalnościowych efektów kształcenia

\*\*\* - z tabeli powyżej