

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 N2.Rozwiązywanie problemów N3.Ćwiczenia

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

<b>Oceny</b> (F – formująca (w trakcie semestru), P – podsumowująca (na koniec semestru))	Numer efektu kształcenia	Sposób oceny osiągnięcia efektu kształcenia
P1	PEK_W01 ÷ PEK_W03, PEK_U01, PEK_U01, PEK_K01	Sprawdzian pisemny
S1	PEK_W01 ÷ PEK_W03, PEK_U01, PEK_U01, 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)**

**Tadeusz Dudycz, [Tadeusz.dudycz@pwr.edu.pl](mailto:Tadeusz.dudycz@pwr.edu.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, Se1÷Se7	N1, N2, N3
<b>PEK_W02 (wiedza)</b>	S2_IZF_W06 S2_IZF_W04	C1, C2	Wy2÷Wy6, Se1÷Se7	N1, N2, N3
<b>PEK_W03 (wiedza)</b>	S2_IZF_W06	C1, C2	Wy7, Se1÷Se7	N1, N2
<b>PEK_U01 (umiejętności)</b>	S2_IZF_U06	C1	Wy1÷Wy7, Se1÷Se7	N1, N2, N3
<b>PEK_U02 (umiejętności)</b>	S2_IZF_U06	C1, C2	Wy1÷Wy7, Se1÷Se7	N1, N2, N3
<b>PEK_K01 (kompetencje)</b>	K2_ZARZ_K05	C1, C2	Wy1÷Wy7, Se1÷Se7	N1, N2, N3

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

\*\*\* - z tabeli powyżej