

Zarządzanie ryzykiem finansowym - opis przedmiotu

Informacje ogólne	
Nazwa przedmiotu	Zarządzanie ryzykiem finansowym
Kod przedmiotu	04.3-WZ-ZarzD-ZRF-S16
Wydział	Wydział Ekonomii i Zarządzania
Kierunek	Zarządzanie / Finanse przedsiębiorstw
Profil	ogólnoakademicki
Rodzaj studiów	drugiego stopnia z tyt. magistra
Semestr rozpoczęcia	semestr zimowy 2016/2017

Informacje o przedmiocie	
Semestr	3
Liczba punktów ECTS do zdobycia	3
Typ przedmiotu	obowiązkowy
Język nauczania	polski
Sylabus opracował	- dr hab. inż. Karolina Mazur, prof. UZ - dr inż. Anna Łobos

Formy zajęć					
Forma zajęć	Liczba godzin w semestrze (stacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (stacjonarne)	Liczba godzin w semestrze (niestacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (niestacjonarne)	Forma zaliczenia
Wykład	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę
Ćwiczenia	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę

Cel przedmiotu

Zdobycie przez studentów umiejętności doboru i wykorzystywania narzędzi z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym w przedsiębiorstwie. Przygotowanie do samodzielnego pomiaru ryzyka finansowego. Nabycie przez studenta umiejętności samodzielnego zastosowania praktycznego narzędzi zarządzania ryzykiem finansowym w przedsiębiorstwie

Wymagania wstępne

Podstawowa wiedza z zakresu matematyki, statystyki i zarządzania finansami.

Zakres tematyczny

Treści wykładów:

Podstawowe podejścia do ryzyka finansowego w przedsiębiorstwie (koncepcja negatywna i koncepcja neutralna). Istota ryzyka finansowego i jego rodzaje. Miary ryzyka finansowego: miary zmienności i miary wrażliwości. Teoria Markowitza. Analiza zagrożenia upadłością. Instrumenty pochodne jako narzędzia zarządzania ryzykiem finansowym.

Treści ćwiczeń:

Omówienie programu ćwiczeń i założeń obowiązujących przy przygotowaniu projektu. Przykład zastosowania VaR. Statystyczne miary ryzyka finansowego w przedsiębiorstwie. Analiza ryzyka upadłości przedsiębiorstw. Szacowanie zmienności stóp akcji – pomiar współczynników beta dla wybranych podmiotów. Strategie zarządzania ryzykiem za pomocą instrumentów pochodnych. Prezentacja projektów wykonanych przez studentów

Metody kształcenia

Podczas wykładu wykorzystane zostaną następujące metody kształcenia: wykład konwencjonalny.

W czasie ćwiczeń wykorzystane zostaną następujące metody kształcenia: klasyczna metoda problemowa i metoda projektu.

Efekty uczenia się i metody weryfikacji osiągnięcia efektów uczenia się

Opis efektu	Symbole efektów	Metody weryfikacji	Forma zajęć
Student posiada wiedzę o rodzajach ryzyka finansowego i potrafi je rozpoznać	- K_W05 - K_W13 - K_U02	kolokwium	Wykład
Student zna metody i techniki pozyskiwania danych w warunkach niepewności	K_W05	projekt	Ćwiczenia

Opis efektu	Symbole efektów	Metody weryfikacji	Forma zajęć
Student zna instrumenty zarządzania ryzykiem finansowym i potrafi dokonać właściwej ich selekcji.	• K_W13 • K_U03 • K_U07 • K_U12	• aktywność w trakcie zajęć • kolokwium • projekt	• Ćwiczenia
Student potrafi oszacować ryzyko finansowe poprzez wyznaczenie współczynnika beta.	• K_U14 • K_K09	• projekt	• Ćwiczenia

Warunki zaliczenia

1. Wykłady z przedmiotu kończą się zaliczeniem z oceną.
2. Oceny wystawiane będą w następujący sposób: 51% - dost, 67% - dst plus, 70% - dobry, 77% - dobry plus, 85% - bdb.
3. Ćwiczenia z przedmiotu kończą się zaliczeniem z oceną.
4. W skład oceny końcowej wchodzi projekt indywidualny oraz ocena aktywności na zajęciach w proporcji 60/40. Oceny w wystawiane będą w następujący sposób: 51% - dost, 67% - dst plus, 70% - dobry, 77% - dobry plus, 85% - bdb 51% - dost, 67% - dst plus, 70% - dobry, 77% - dobry plus, 85% - bdb.

Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest uzyskanie pozytywnej oceny z obu form zajęciowych. Ocena końcowa z przedmiotu jest średnią arytmetyczną oceny z wykładu i ćwiczeń (40% wykład, 60% ćwiczenia).

Literatura podstawowa

1. **Jajuga K., Zarządzanie ryzykiem, PWN, Warszawa 2007.**
2. Tarczyński W., Mojsiewicz M., Zarządzanie ryzykiem: podstawowe zagadnienia, PWE, Warszawa 2001.
3. Kaczmarek T.T., Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Ujęcie interdyscyplinarne, Difin, Warszawa 2006.
4. Nahotko S., Ryzyko ekonomiczne w działalności gospodarczej, Oficyna Wydawnicza Ośrodka Postępu Organizacyjnego, Bydgoszcz 2001.

Hanis R. N., Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwie, WSB Dąbrowa Górnicza, Dąbrowa Górnicza 2010

Literatura uzupełniająca

1. Jajuga K., Ryzyko w finansach: ujęcie statystyczne, Wydawnictwo AE w Krakowie, Kraków 1996.
2. **Witkowski M., Ryzyko gospodarcze i jego pomiar: zagadnienia wybrane, PWSZ w Kaliszu, Kalisz 2009.**
3. Capiga M., Ogrodnik H., Ryzyko w działalności przedsiębiorstwa, banku i zakładu ubezpieczeń, Wydawnictwo AE w Katowicach, Katowice 2007.
4. Iwanicz-Drozdowska M., Nowak A., Ryzyko bankowe, Oficyna SGH, Warszawa 2002.
5. Janasz K., Ryzyko kredytowe w systemie bankowym, Uniwersytet Szczeciński, Szczecin 2004.

Uwagi

Zmodyfikowane przez dr hab. inż. Karolina Mazur, prof. UZ (ostatnia modyfikacja: 09-09-2016 10:59)

Wygenerowano automatycznie z systemu SylabUZ