

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

| I. OGÓLNE INFORMACJE PODSTAWOWE O PRZEDMIOCIE (MODULE) | | | | | | | | | | | |
|--|---|--------------------------|---|---|---------|------------|----------|----|----------------------|---|-------------|
| Metody zarządzania ryzykiem | | | | | | | | | | | |
| Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej kierunek: | | | | Uczelnia Biznesu i Nauk Stosowanych „Varsovia” w Warszawie | | | | | | | |
| Nazwa kierunku studiów, poziom kształcenia: | | | | Rachunkowość i finanse, studia I stopnia | | | | | | | |
| Liczba punktów ECTS | | | | 4 | | | | | | | |
| Język przedmiotu- polski, angielski, inny | | | | polski | | | | | | | |
| Profil kształcenia: | | | | PRAKTYCZNY | | | | | | | |
| Nazwa specjalności: | | | | Zarządzanie ryzykiem w finansach | | | | | | | |
| Rodzaj modułu kształcenia: (wskazać właściwe) | | | | Podstawowy / kierunkowy/ <u>specjalnościowy</u> /obowiązkowy/fakultatywny | | | | | | | |
| Rok / Semestr: | | | | III/6 | | | | | | | |
| Osoba koordynująca przedmiot: | | | | Koordynator kierunku | | | | | | | |
| Wymagania wstępne (wynikające z następstwa przedmiotów): | | | | Przedmioty kierunkowe z semestrów 1-4 | | | | | | | |
| II. FORMY ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH ORAZ WYMIAR GODZIN | | | | | | | | | | | |
| | Wykład | Ćwiczenia/konwersatorium | Laboratorium | Warsztaty | Projekt | Seminarium | Praktyki | Ko | Egzamin / zaliczenie | Suma godzin | Ogółem ECTS |
| Studia stacjonarne | | 20 | | | 4 | | | 4 | 2 | 30 | 3 |
| Studia niestacjonarne | | 12 | | | 4 | | | 4 | 2 | 22 | 3 |
| III. METODY REALIZACJI ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH | | | | | | | | | | | |
| Formy zajęć | | | Metody dydaktyczne (właściwe podkreślić) | | | | | | | | |
| Wykład/Ćwiczenia/Warsztat/Projekt/Laboratorium | | | Wykład z dyskusją ukierunkowaną wykład z prezentacją multimedialną case study, <u>metoda sytuacyjna.</u> <u>metoda projektów.</u> dyskusja dydaktyczna. Ćwiczenia rachunkowe Ćwiczenia z wykorzystaniem narzędzi informatycznych - edukacyjna gra Gra symulacyjna Drama Inne | | | | | | | | |
| IV. PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ Z ODNIESIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKU | | | | | | | | | | | |
| Lp. | Opis przedmiotowych efektów uczenia się | | | | | | | | | Odniesienie do efektu kierunkowego symbol | |
| Wiedza: | | | | | | | | | | | |
| P_W01 | Zna definicje ryzyka, rodzaje ryzyka, elementy procesu zarządzania ryzykiem, znaczenie ryzyka w podejmowaniu decyzji finansowych oraz znaczenie teorii ryzyka w teorii finansów | | | | | | | | | K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 | |
| P_W02 | Zna najważniejsze podstawowe i zaawansowane metody pomiaru, sterowania i weryfikacji modeli ryzyka rynkowego | | | | | | | | | K1P_W07, K1P_W09, | |

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

| | | |
|-------------------------------|---|---|
| | | K1P_W10, K1P_W11 |
| P_W03 | Zna najważniejsze podstawowe i zaawansowane metody analizy ryzyka kredytowego | K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 |
| P_W04 | Zna najważniejsze metody analizy ryzyka operacyjnego | K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 |
| P_W05 | Zna główne zasady i dobre praktyki dotyczące struktury i funkcjonowania systemu zarządzania ryzykiem w organizacji | K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 |
| P_W06 | Ma ogólną wiedzę w zakresie wybranych innych rodzajów ryzyka związanego z inwestycjami finansowymi | K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 |
| P_W07 | Zna wybrane najważniejsze zagadnienia związane z problematyką ryzyka systemowego, a także zna elementy metod analizy i dobrych praktyk w zakresie ryzyka systemu finansowego | K1P_W06, K1P_W07, K1P_W09, K1P_W10, K1P_W11 |
| Umiejętności: | | |
| P_U01 | Umie przedstawić i zinterpretować definicje ryzyka, umie wymienić rodzaje ryzyka, elementy procesu zarządzania ryzykiem, potrafi wyjaśnić znaczenie ryzyka w podejmowaniu decyzji finansowych oraz znaczenie teorii ryzyka w teorii finansów | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| P_U02 | Potrafi zidentyfikować czynniki ryzyka w przypadku wybranych hipotetycznych bądź rzeczywistych inwestycji finansowych | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| P_U03 | Umie zaproponować, wybrać i zastosować niektóre podstawowe i zaawansowane metody pomiaru ryzyka związanego z inwestycjami finansowymi | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| P_U04 | Umie zaproponować, wybrać i zastosować niektóre podstawowe i zaawansowane metody sterowania ryzykiem związanego z inwestycjami finansowymi | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| P_U05 | Umie zaproponować, wybrać i zastosować niektóre podstawowe i zaawansowane metody weryfikacji modelu ryzyka związanego z inwestycjami finansowymi | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| P_U06 | Umie wskazać i zinterpretować główne zasady i dobre praktyki dotyczące struktury i funkcjonowania systemu zarządzania ryzykiem w organizacji oraz przewidzieć najbardziej prawdopodobne skutki niektórych nieprawidłowości w systemie zarządzania ryzykiem w uproszczonych modelowych przypadkach | K1P_U04, K1P_U05, K1P_U06, K1P_U09, K1P_U10 |
| Kompetencje społeczne: | | |
| P_K01 | Jest gotów do poszerzania i pogłębiania swojej wiedzy oraz doskonalenia umiejętności w zakresie metod pomiaru ryzyka, sterowania ryzykiem i weryfikacji modelu ryzyka dla różnych rodzajów instrumentów finansowych i ich portfeli oraz różnych rodzajów ryzyka | K1P_K02 |

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

| | | |
|--|--|--|
| P_K02 | Jest gotów do wykorzystania swojej wiedzy w zakresie ryzyka finansowego na rzecz interesu publicznego | K1P_K04 |
| V. TREŚCI KSZTAŁCENIA | | |
| Lp. | Ćwiczenia/Projekt/Laboratorium (właściwe wybrać) | Odniesienie do przedmiotowych efektów uczenia się |
| T1 | Pojęcie ryzyka i jego rodzaje, proces zarządzania nim oraz relacje między teorią ryzyka a innymi obszarami w ramach dyscypliny finanse | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T2 | Podstawowe oraz wybrane zaawansowane metody pomiaru ryzyka rynkowego | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T3 | Podstawowe oraz wybrane zaawansowane metody weryfikacji modelu wartości zagrożonej (back-testing) | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T4 | Podstawowe oraz wybrane zaawansowane metody sterowania ryzykiem rynkowym | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T5 | Ryzyko kredytowe | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T6 | Ryzyko operacyjne, wybrane inne rodzaje ryzyka i elementy zintegrowanego podejścia do analizy ryzyka | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T7 | Najważniejsze błędy w zarządzaniu ryzykiem, przykłady katastrof finansowych spowodowanych niewłaściwym zarządzaniem ryzykiem oraz wnioski z nich płynące | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| T8 | Analiza ryzyka systemowego | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| P1 | Case studies | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| VI. METODY WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ | | |
| Forma zajęć, w ramach której weryfikowany jest EU | Metoda weryfikacji (WŁAŚCIWE WYBRAĆ) Egzamin pisemny, egzamin ustny, kolokwium, projekt, prezentacja, referat, esej inne | Kategoria weryfikowanych efektów uczenia się: wiedza, umiejętności, kompetencje społeczne WŁAŚCIWE WYBRAĆ |
| Ćwiczenia | Praca zaliczeniowa | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| Zajęcia projektowe | Projekt – case studies | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| WARUNKI ZALICZENIA PRZEDMIOTU wskazać właściwe | | |
| | Zaliczenie wszystkich form zajęć przedmiotu (Ćwiczeń, projektu, laboratorium, pozytywna ocena egzaminu, INNE | |
| Ćwiczenia | Pozytywnie zaliczona praca pisemna | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| Zajęcia projektowe | Pozytywnie zaliczony projekt, ocena pracy w grupie, | P_W01_P_W07, P_U01_P_U06, P_K01_P_K02 |
| VIII. NAKŁAD PRACY STUDENTA – WYMIAR GODZIN I BILANS PUNKTÓW ECTS | | |
| Rodzaj aktywności | | Obciążenie studenta |

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

| ECTS | Studia stacjonarne | Studia niestacjonarne |
|---|--------------------|-----------------------|
| 1.Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów dydaktycznych (wykłady, ćwiczenia, konwersatoria, projekt, laboratoria, warsztaty, seminaria) – SUMA godzin – z punktu II | 30 | 24 |
| W tym | | |
| 1.1. Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów | 24 | 18 |
| 1.2. Egzaminy/zaliczenia -liczba godzin | 2 | 2 |
| 1.3. Udział w konsultacjach -liczba godzin | 4 | 4 |
| 2. Indywidualna praca własna studenta - liczba godzin – Projekt / esej / studium przypadku / zadanie praktyczne, samodzielne przygotowanie się do zajęć, egzaminów, zaliczeń | 45 | 51 |
| Sumaryczne obciążenie pracą studenta (25h = 1 ECTS) SUMA godzin i ECTS | 75/3 | 75/3 |
| IX. LITERATURA PRZEDMIOTU ORAZ INNE MATERIAŁY DYDAKTYCZNE | | |
| Literatura podstawowa przedmiotu: Jajuga K., 2024, Zarządzanie ryzykiem, Wydawnictwo Naukowe PWN Zawiła-Niedźwiecki J, 2023, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym w zapewnianiu ciągłości działania organizacji, edu-Libri | | |
| Literatura uzupełniająca przedmiotu: Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowej, Hull J.C., Wydawnictwa Profesjonalne PWN, Warszawa, 2011 Pomiar ryzyka przedsiębiorstwa. Modele pomiaru i ich ryzyko, Kuziak K., Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, Wrocław, 2011 Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Jajuga K., Jajuga T., Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2006 Ryzyko kredytowe, Krysiak Z., Oficyna Ekonomiczna, Kraków, 2006 Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Matkowski P., Wolters Kluwer, Warszawa, 2006 | | |
| Inne materiały dydaktyczne: | | |