

Opis zajęć (syllabus): Teoria ryzyka

Nazwa zajęć:	Teoria ryzyka	ECTS	3
Nazwa zajęć w j. angielskim:	Risk Theory		
Zajęcia dla kierunku studiów:	Finanse i Rachunkowość		

Język wykładowy: polski		Poziom studiów: 2	
Forma studiów: stacjonarne i niestacjonarne	Status zajęć: kierunkowy - obowiązkowy	Numer semestru: 1 semestr zimowy	
Rok akademicki, od którego obowiązuje opis (rocznik):		2020/2021	Numer katalogowy: EKR-F-2SZ-1-07-KO-2020

Koordynator zajęć:	dr Monika Utzig, adiunkt		
Prowadzący zajęcia:	dr Monika Utzig, adiunkt dr inż. Aneta Mikuła, adiunkt		
Jednostka realizująca:	Katedra Ekonomii i Polityki Gospodarczej		
Jednostka zlecająca:	Wydział Ekonomiczny		
Założenia, cele i opis zajęć:	a. Zapoznanie studentów z teorią ryzyka. b. Zapoznanie studentów z metodami zarządzania ryzykiem i mierzenia go. c. Kształtowanie umiejętności identyfikowania i ograniczania ryzyka w różnych obszarach działalności gospodarczej. Wykład Pojęcie i klasyfikacja ryzyka. Ryzyko spekulacyjne a czyste. Ryzyko a niepewność. Skłonność do ryzyka. Wybór w warunkach ryzyka. Funkcja wartości i funkcja wag decyzyjnych. Miary zmienności, wrażliwości i zagrożenia. Względne i bezwzględne miary ryzyka spekulacyjnego i czystego. Value at Risk. Mierzenie ryzyka inwestycji w akcje. Elementy procesu zarządzania ryzykiem. Ryzyko w przedsiębiorstwie. Ryzyko w banku. Ryzyko kredytowe. Ryzyko walutowe. Wykorzystanie kontraktów terminowych forward, futures i opcji walutowych. Informacja gospodarcza jako czynnik ograniczający ryzyko. Ćwiczenia Istota ryzyka. Oczekiwana użyteczność. Prawdopodobieństwo subiektywne. Mierzenie ryzyka: miary zmienności, wrażliwości i zagrożenia. Mapa dochód-ryzyko. Mierzenie ryzyka w przedsiębiorstwie. Kategorie ryzyka bankowego i ich charakter. Wykorzystywanie źródeł informacji o sytuacji finansowej kontrahenta (KRS, BIK, BIG i inne). Ryzyko walutowe – przykłady.		
Formy dydaktyczne, liczba godzin:	a. wykład - liczba godzin: stacj: 15, niestacj. 8 b. ćwiczenia audytoryjne - liczba godzin: stacj: 15, niestacj. 8		
Metody dydaktyczne:	dyskusja, rozwiązywanie problemu, analiza i interpretacja tekstów źródłowych, konsultacje, wykład konwersacyjny, studium przypadku		
Wymagania formalne i założenia wstępne:	Nie dotyczy		
Efekty uczenia się:	Wiedza - Zna i rozumie: 1. podstawy teoretyczne ryzyka w różnych obszarach działalności 2. kierunki i treści współczesnych doktryn z zakresu teorii ryzyka	Umiejętności - Potrafi: 3. mierzyć ryzyko w różnych obszarach działalności z wykorzystaniem poznanych miar 4. identyfikować ryzyko w różnych rodzajach działalności	Kompetencje - Jest gotów do: 5. uznawania znaczenia wiedzy dotyczącej ryzyka w praktyce gospodarczej
Sposób weryfikacji efektów uczenia się:	kolokwium na ćwiczeniach (efekty: 3, 4), egzamin pisemny (efekty: 1, 2), ocena aktywności w trakcie zajęć (efekty: 5)		
Forma dokumentacji osiągniętych efektów uczenia się:	prace pisemne, karty oceny studenta (w tym na listach obecności)		
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową:	kolokwium na ćwiczeniach - 40%, egzamin pisemny - 50%, ocena aktywności w trakcie zajęć - 10%		
Miejsce realizacji zajęć:	sala dydaktyczna (wykładowa/ćwiczeniowa)		
Literatura podstawowa i uzupełniająca:			
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 2005.			

Uwagi:

Wskaźniki ilościowe charakteryzujące moduł/przedmiot:

Szacunkowa sumaryczna liczba godzin pracy studenta (kontaktowych i pracy własnej) niezbędna dla osiągnięcia zakładanych dla zajęć efektów uczenia się - na tej podstawie należy wypełnić pole ECTS:

75/75

Łączna liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich lub innych osób prowadzących zajęcia:

1.76/0.88 ECTS

Tabela zgodności kierunkowych efektów uczenia się z efektami przedmiotu:

Kategoria efektu	Efekty uczenia się dla zajęć:	Odniesienie do efektów dla programu studiów dla kierunku	Oddziaływanie zajęć na efekt kierunkowy*)
Wiedza	1. podstawy teoretyczne ryzyka w różnych obszarach działalności	FIR2_KW01	2
	2. kierunki i treści współczesnych doktryn z zakresu teorii ryzyka	FIR2_KW04	2
Umiejętności	3. mierzyć ryzyko w różnych obszarach działalności z wykorzystaniem poznanych miar	FIR2_KU01	2
	4. identyfikować ryzyko w różnych rodzajach działalności	FIR2_KU04	2
Kompetencje	5. uznawania znaczenia wiedzy dotyczącej ryzyka w praktyce gospodarczej	FIR2_KK01	2

*) 3 – zaawansowany i szczegółowy, 2 – znaczący, 1 – podstawowy