

Opis przedmiotu

1. Nazwa przedmiotu: **Zarządzanie ryzykiem**
2. Kod przedmiotu:
3. Język wykładowy: polski
4. Kierunek: finanse i rachunkowość
5. Specjalność:
6. Rok: III Semestr: 5
7. Tytuł/stopień oraz imię i nazwisko prowadzącego przedmiot:
dr hab. inż. Zofia Wilimowska, prof. PWSZ w Nysie
8. Tytuły/stopnie oraz imiona i nazwiska pozostałych członków zespołu:
mgr Joanna Szczepańska
9. Formy zajęć wchodzące w skład przedmiotu, wymiar godzinowy, forma zaliczenia:

Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia/ Ćwiczenia tablicowe	Laboratorium/ Ćwiczenia praktyczne	Projekt	Seminarium
Liczba godzin w semestrze	30	15			
Forma zaliczenia	Zaliczenie Pisemne	Kolokwia/aktywność			

10. Liczba punktów ECTS: 3
11. Poziom (podstawowy/zaawansowany): podstawowy
12. Wymagania wstępne:

Pozytywne zaliczenie kursów: matematyka, zastosowanie matematyki w finansach i bankowości, zarządzanie finansami przedsiębiorstw, zarządzanie ryzykiem walutowym.

13. Cele kształcenia:

W dynamicznie zmieniającym się otoczeniu ryzyko związane z prowadzoną przez organizację działalnością jest podstawowym elementem decyzji menedżerskich. Celem kursu jest pokazanie źródeł ryzyka różnych jednostek gospodarczych (przedsiębiorstwo, bank, firma ubezpieczeniowa) oraz metod redukcji ryzyka.

14. Opis treści kształcenia w ramach poszczególnych form zajęć:

- 14.1. Wykład:

Ryzyko finansowe i jego rodzaje. Pomiar ryzyka rynkowego. Konstrukcja linii charakterystycznej papieru wartościowego. Pomiar ryzyka kredytowego. Ryzyko w przedsiębiorstwie. Ryzyko w banku. Ryzyko w towarzystwie ubezpieczeniowym. Ryzyko w funduszu inwestycyjnym. Zarządzanie ryzykiem rynkowym za pomocą kształtowania

struktury aktywów i pasywów. Zarządzanie ryzykiem kredytowym. Hedging. Instrumenty pochodne w zarządzaniu ryzykiem. Zarządzanie ryzykiem walutowym. Modele rynkowe. Algorytmy rozpoznawania obrazów.

14.2. Ćwiczenia/Ćwiczenia tablicowe:

Statystyczne miary ryzyka, tworzenie portfela akcji, linia charakterystyczna papieru wartościowego (SML), linia rynku kapitałowego (CML), model wyceny dóbr kapitałowych (CAPM), rynek pieniężny, hedging, instrumenty pochodne w zarządzaniu ryzykiem, algorytmy rozpoznawania obrazów.

14.3. Laboratorium/ Ćwiczenia praktyczne:

14.4. Projekt:

14.5. Seminarium:

15. Literatura podstawowa:

- Podstawy zarządzania finansami / Brigham E.F., PWN, Warszawa, 1995.
- Sztuka zarządzania finansami / Wilimowska Z., Wilimowski M., TNOiK OPO Bydgoszcz, 2001.
- Metodyka budowy efektywnego portfela projektów inwestycyjnych / Wilimowska Z., Oficyna Wydawnicza Politechniki Wrocławskiej, Wrocław 1997.
- Zarządzanie ryzykiem : podstawowe zagadnienia / Waldemar Tarczyński, Magdalena Mojsiewicz, PWE, Warszawa 2001.
- Zarządzanie ryzykiem dla menedżerów : praktyczne podejście do kontrolowania ryzyka / Robin Kendall; tł. z ang. Marcin Sieczyk, K.E. Liber, Warszawa 2000.

16. Literatura towarzysząca: