

**Sylabus przedmiotu – część A**
Ryzyko na rynku finansowym**37N2-RNRF****ECTS: 3.5****CYKL: 2021Z****TREŚCI MERYTORYCZNE****WYKŁAD**

Definicja ryzyka. Systematyka ryzyka i niepewności w działalności przedsiębiorstwa. Charakterystyka i rodzaje ryzyka finansowego – ryzyko płynności, ryzyko walutowe, ryzyko stopy procentowej, ryzyko rynkowe. Ryzyko w działalności przedsiębiorstwa niefinansowego. Pomiar ryzyka finansowego. Metody wewnętrzne i zewnętrzne w ograniczaniu ryzyka. Zastosowanie instrumentów pochodnych w ograniczaniu ryzykiem finansowym. Ryzyko upadłości metody do jego pomiaru.

ĆWICZENIA

Rodzaje ryzyka na rynku finansowym. Identyfikacja ryzyka. Metody zewnętrzne do ograniczenia ryzyka. Zastosowanie instrumentów pochodnych do ograniczenia ryzyka. Analiza duracji do pomiaru ryzyka stopy procentowej. Analiza i pomiar ryzyka finansowego. Metody wewnętrzne do ograniczenia ryzyka – kompensowanie pierwotne i wtórne. Modele dyskryminacyjne stosowane w analizie ryzyka niewypłacalności przedsiębiorstwa przy wykorzystaniu danych bazy Eikon Refinitiv.

CEL KSZTAŁCENIA

Celem przedmiotu jest zaprezentowanie podstawowych pojęć z zakresu ryzyka na rynku finansowym. Zajęcia obejmują zagadnienia związane z definicją, klasyfikacją, źródłami powstawania ryzyka oraz wybranymi metodami ograniczenia.

OPIS EFEKTÓW UCZENIA SIĘ PRZEDMIOTU W ODNIESIENIU DO OPISU**CHARAKTERYSTYK DRUGIEGO STOPNIA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ DLA KWALIFIKACJI NA POZIOMACH 6-8 POLSKIEJ RAMY KWALIFIKACJI W ODNIESIENIU DO DYSCYPLIN NAUKOWYCH I EFEKTÓW KIERUNKOWYCH****Symbole efektów dyscyplinowych:**S/EFA_P7S_UW+++; S/EFA_P7S_KK++; S/EFA_P7S_WG+++;
S/EFA_P7S_UU+**Symbole efektów kierunkowych:**KA7_WG3 ++, KA7_KK1+, KA7_UW1 ++, KA7_KK2+,
KA7_UW2++, KA7_WG5+, KA7_UW3+, KA7_UU1 +,
KA7_WG1 +**EFEKTY UCZENIA SIĘ:****Wiedza:**

W1 –Definiuje, identyfikuje i rozpoznaje ryzyko na rynku finansowym

W2 –Zna wybrane metody do ograniczenia ryzyka na rynku finansowym

Umiejętności:

U1 –Nabywa umiejętności w identyfikowaniu źródeł i podstawowych miar ryzyka na rynku finansowym

U2 –Nabywa umiejętności z zastosowania wybranych metod do ograniczenia ryzyka w przedsiębiorstwie

Kompetencje społeczne:**Akty prawne określające efekty uczenia się:**

80/2021

Dyscypliny: ekonomia i finanse, nauki o zarządzaniu i jakości**Status przedmiotu:** Obligatoryjny**Grupa przedmiotów:** C - przedmioty specjalnościowe/związane z zakresem kształcenia**Kod:** ISCED 0311**Kierunek studiów:** Ekonomia**Zakres kształcenia:** Ekonomia menedżerska i doradztwo finansowe**Profil kształcenia:** Ogólnoakademicki**Forma studiów:** Niestacjonarne**Poziom studiów:** Drugiego stopnia**Rok/semestr:** 2/3**Rodzaj zajęć:** Wykład, Ćwiczenia**Liczba godzin w semestrze:** Wykład: 10.00, Ćwiczenia: 10.00**Język wykładowy:** polski**Przedmioty wprowadzające:** Rynek finansowy, Finanse**Wymagania wstępne:** Znajomość podstaw finansów**Nazwa jednostki org. realizującej przedmiot:** Instytut Ekonomii i Finansów**Osoba odpowiedzialna za realizację przedmiotu:** dr inż. Artur Wyszynski
e-mail: arturwy@uwm.edu.pl**Uwagi dodatkowe:**

K1 –Potrafi rozwijać i pogłębiać zdobytą wiedzę i umiejętności w zakresie oceny ryzyka na rynku finansowym

FORMY I METODY DYDAKTYCZNE:

Wykład(W1, W2, U1, U2, K1):Wykład informacyjny, wykład problemowy.

Ćwiczenia(W1, W2, U1, U2, K1):Analiza wybranych zagadnień z wykorzystaniem zadań i studiów przypadków.

FORMA I WARUNKI WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ:

Ćwiczenia: Kolokwium pisemne - Warunkiem zaliczenia ćwiczeń jest rozwiązanie zadań i uzyskanie co najmniej 60% procent punktów z kolokwium. (W1, W2, U1, U2, K1);

Wykład: Egzamin pisemny - Warunkiem zdania egzaminu jest odpowiedź na co najmniej 60% procent zadanych pytań. (W1, W2, U1, U2, K1);

LITERATURA PODSTAWOWA:

1. Jajuga K., tytuł: Zarządzanie ryzykiem, wyd. PWN, rok 2018
2. Hull J., tytuł: Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych, wyd. Wydawnictwo Naukowe PWN, rok 2021

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

1. Kaczmarek T., tytuł: Ryzyko i zarządzanie ryzykiem. Ujęcie interdyscyplinarne, wyd. Difin, rok 2005
2. Wyszynski A., tytuł: Niewypłacalność zawodowych klubów piłki nożnej, wyd. Ekonomista, rok 2021
3. Hull J., tytuł: Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie, wyd. Wig-Press, rok 1999

Szczegółowy opis przyznanej punktacji ECTS – część B

37N2-RNRF

ECTS: 3.5

CYKL: 2021Z

Ryzyko na rynku finansowym

Na przyznaną liczbę punktów ECTS składają się:

1. Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim:

- udział w: Wykład	10.0 h
- udział w: Ćwiczenia	10.0 h
- konsultacje	2.0 h
OGÓŁEM: 22.0h	

2. Samodzielna praca studenta:

przygotowanie do ćwiczeń	12.50 h
przygotowanie do kolokwium	30.00 h
przygotowanie do egzaminu	30.00 h

OGÓŁEM: 72.5h

godziny kontaktowe + samodzielna praca studenta OGÓŁEM: 94.5h

1 punkt ECTS = 25-30 h pracy przeciętnego studenta,
liczba punktów ECTS= $94.5 \text{ h} : 27.0 \text{ h/ECTS} = 3.50 \text{ ECTS}$

Średnio: 3.5 ECTS

- w tym liczba punktów ECTS za godziny kontaktowe z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego	0.81 punktów ECTS
- w tym liczba punktów ECTS za godziny realizowane w formie samodzielnej pracy studenta	2.69 punktów ECTS