

<p>Ocena formująca: a)w zakresie ćwiczeń Bieżąca kontrola stopnia opanowania wiedzy poprzez pytania i dyskusje na zajęciach.</p> <p>b)w zakresie wykładu: Pytania kontrolne na temat treści z poprzednich wykładów zadawane na początku i w trakcie kolejnych wykładów.</p> <p>Ocena podsumowująca: W zakresie ćwiczeń i wykładów: tekst końcowy. Wymagany stopień opanowania materiału: co najmniej 60% poprawnych odpowiedzi.</p>		
Treści programowe		
<p>Główne rodzaje ryzyka w działalności przedsiębiorstw. Ryzyko operacyjne ? obszary występowania, klasyfikacja. Metody i instrumenty zarządzania ryzykiem operacyjnym, jego pomiaru i ograniczenia. Definicja i klasyfikacja ryzyka finansowego. Szczegółowa prezentacja głównych rodzajów ryzyka finansowego (ryzyko kredytowe, ryzyko walutowe, ryzyko stóp procentowych, ryzyko płynności, ryzyko związane z niewłaściwym stosowaniem instrumentów pochodnych). Analiza portfelowa. Dywersyfikacja ryzyka portfela produktowego i papierów wartościowych. Towarowe i finansowe kontrakty terminowe w zarządzaniu ryzykiem finansowym. Wycena opcji finansowych i towarowych a zarządzanie ryzykiem. Ryzyko niewyptalności i modele analizy dyskryminacyjnej firm.</p>		
<p>Literatura podstawowa:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. A.Tarantino, D.Cernauskas, Essentials of Risk Management in Finance, John Wiles & Sons, New Jersey 2011. 2. P.Matkowski, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Wolters Kluwer Polska, Kraków 2006. 		
<p>Literatura uzupełniająca:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Z.Krysiak, Ryzyko kredytowe a wartość firmy, Walters Kluwer Polska, Warszawa 2006. 		
Bilans nakładu pracy przeciętnego studenta		
Czynność		Czas (godz.)
1. Wykład		15
2. Ćwiczenia		15
3. Konsultacje ćwiczeń		26
4. Przygotowanie do ćwiczeń		20
5. Przygotowanie do kolokwium zaliczeniowego		20
6. Kolokwium zaliczeniowe (test)		2
7. Omówienie wyników kolokwium zaliczeniowego.		2
Obciążenie pracą studenta		
forma aktywności	godzin	ECTS
Łączny nakład pracy	100	4
Zajęcia wymagające bezpośredniego kontaktu z nauczycielem	60	2
Zajęcia o charakterze praktycznym	15	1