

<b>KARTA OPISU MODUŁU KSZTAŁCENIA</b>		
Nazwa modułu/przedmiotu <b>Zarządzanie ryzykiem operacyjnym i finansowym</b>		Kod <b>1011102211011138336</b>
Kierunek studiów <b>Inżynieria zarządzania - studia stacjonarne II</b>	Profil kształcenia (ogólnoakademicki, praktyczny) <b>(brak)</b>	Rok / Semestr <b>1 / 1</b>
Ścieżka obieralności/specjalność <b>Zarządzanie przedsiębiorstwem</b>	Przedmiot oferowany w języku: <b>polski</b>	Kurs (obligatoryjny/obieralny) <b>obieralny</b>
Stopień studiów: <b>II stopień</b>	Forma studiów (stacjonarna/niestacjonarna) <b>stacjonarna</b>	
Godziny Wykłady: <b>15</b> Ćwiczenia: <b>15</b> Laboratoria: <b>-</b> Projekty/seminaria: <b>-</b>		Liczba punktów <b>2</b>
Status przedmiotu w programie studiów (podstawowy, kierunkowy, inny) <b>(brak)</b>		(ogólnouczelniany, z innego kierunku) <b>(brak)</b>
Obszar(y) kształcenia i dziedzina(y) nauki i sztuki <b>nauki społeczne</b>		Podział ECTS (liczba i %) <b>2 100%</b>
<b>Odpowiedzialny za przedmiot / wykładowca:</b>		
dr hab. Marek Szczepański, prof. PP email: marek.szczepanski@put.poznan.pl tel. 616653393 Wydział Inżynierii Zarządzania ul. Strzelecka 11, 60-965 Poznań		dr Tomasz Brzęczek email: tomasz.brzeczek@put.poznan.pl tel. 64 665 33 92 Wydział Inżynierii Zarządzania ul. Strzelecka 11, 60-965 Poznań
<b>Wymagania wstępne w zakresie wiedzy, umiejętności, kompetencji społecznych:</b>		
1	<b>Wiedza:</b>	Podstawowa wiedza z zakresu finansów oraz zarządzania przedsiębiorstwem
2	<b>Umiejętności:</b>	znajomość podstawowych kategorii ekonomiczno-finansowych i statystycznych, takich jak pieniądź, cena pieniądza, stopa procentowa, instytucje rynku finansowego.
3	<b>Kompetencje społeczne</b>	świadomość znaczenia przedmiotu
<b>Cel przedmiotu:</b> -celem przedmiotu jest wykształcenie umiejętności identyfikacji, pomiaru i zarządzania ryzykiem operacyjnym i finansowym.		
<b>Efekty kształcenia i odniesienie do kierunkowych efektów kształcenia</b>		
<b>Wiedza:</b>		
1. Student zna w sposób pogłębiony metody i narzędzia modelowania procesów informacyjnych związanych z zarządzaniem ryzykiem - [K2A_W08]		
2. Zna metody i narzędzia modelowania procesów decyzyjnych stosowanych w zarządzaniu ryzykiem operacyjnym i ryzykiem finansowym - [K2A_W09]		
3. Ma pogłębioną wiedzę o procesach zmian struktur organizacyjnych i zarządzaniu tymi zmianami w odniesieniu do zarządzania ryzykiem. - [K2A_W15]		
<b>Umiejętności:</b>		
1. Student potrafi prawidłowo interpretować i wyjaśniać zjawiska społeczne kulturowe, polityczne, prawne, ekonomiczne) oraz wzajemne relacje między zjawiskami społecznymi w aspekcie zarządzania ryzykiem. - [K2A_U01]		
2. Potrafi wykorzystać wiedzę teoretyczną do opisu i analizowania przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk społecznych (kulturowych, politycznych, prawnych, gospodarczych) oraz potrafi formułować własne opinie i dobrać krytycznie dane i metody analiz - [K2A_U02]		
3. Student potrafi właściwie analizować przyczyny i przebieg procesów i zjawisk społecznych (kulturowych, politycznych, prawnych, gospodarczych), formułować własne opinie na ten temat oraz stawiać proste hipotezy badawcze i je weryfikować w zakresie zarządzania ryzykiem operacyjnym i finansowym - [K2A_U03]		
4. Potrafi prognozować i modelować złożone procesy społeczne obejmujące zjawiska z różnych obszarów życia społecznego (kulturowe, polityczne, prawne, ekonomiczne) z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi w zakresie zarządzania ryzykiem operacyjnym oraz ryzykiem finansowym. - [K2A_U04]		
<b>Kompetencje społeczne:</b>		

1. Student ma świadomość odpowiedzialności za pracę własną oraz gotowość podporządkowania się zasadom pracy w zespole i ponoszenia odpowiedzialności za wspólnie realizowane zadania związane z zarządzaniem ryzykiem. - [K2A\_K02]
2. Potrafi dostrzegać zależności przyczynowo skutkowe w realizacji postawionych celów i rangować istotność alternatywnych bądź konkurencyjnych zadań w zakresie zarządzania ryzykiem. - [K2A\_K03]
3. Student potrafi wносить wkład merytoryczny w przygotowanie projektów społecznych z zarządzania ryzykiem operacyjnym i finansowym i zarządzać przedsięwzięciami wynikającymi z tych projektów - [K2A\_K05]
4. Ma świadomość interdyscyplinarności wiedzy i umiejętności potrzebnych do rozwiązywania złożonych problemów organizacji i konieczności tworzenia zespołów interdyscyplinarnych powołanych do zarządzania ryzykiem operacyjnym i ryzykiem finansowym. - [K2A\_K06]

### Sposoby sprawdzenia efektów kształcenia

Ocena formująca z wykładu: test wstępny (obejmujący część materiałów z wykładów i podręcznika).

Ocena podsumowująca z wykładu - test (obejmujący materiał z wykładów i podręcznika).

Ocena formująca (częstkowa) z ćwiczeń:

- ocena aktywności na zajęciach (udział w dyskusji, prezentacje studenckie)
- ocena przygotowanego w grupach projektu dotyczącego programu zarządzania ryzykiem operacyjnym i ryzykiem finansowym w wybranym przedsiębiorstwie.
- kolokwium wstępne

Ocena podsumowująca ćwiczenia - kolokwium końcowe (obejmujące materiał z ćwiczeń i podręcznika).

### Treści programowe

-Treści programowe:

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 portfelową. 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 niewypłacalności i modele analizy dyskryminacyjnej firm.

Metody dydaktyczne wykłady:

- Wykład informacyjny
- Wykład problemowy
- Samodzielna praca z podręcznikiem

Metody dydaktyczne ćwiczenia:

- Ćwiczenia audytoryjne
- Samodzielna praca z podręcznikiem.
- Udział w przygotowaniu projektu zaliczeniowego na ćwiczenia (grupy 3-4 osobowe).

### Literatura podstawowa:

1. Jajuga K. (red.), Zarządzanie ryzykiem, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2009.
2. Staniec I., Zawila-Niedźwiedzki J., Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Wydawnictwo C.H.Beck, Warszawa 2008.
3. Kaczmarek T., Zarządzanie ryzykiem. Ujęcie interdyscyplinarne, Difin, Warszawa 2015.
4. M.Szczepański, Zarządzanie ryzykiem długowieczności w polskim systemie emerytalnym,
5. Zarządzanie ryzykiem, K.Jajuga (red.), Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2009.
6. P.Matkowski, Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, WoltersKluwer Polska, Kraków 2006.
7. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, I.Stanec, J.Zawila-Niedźwiedzki, Wydawnictwo C.H.Beck, Warszawa 2008.
8. Portal wiedzy o ryzyku: <http://www.audytryzka.com>.

### Literatura uzupełniająca:

1. Kaczmarek T., Zarządzanie ryzykiem w handlu międzynarodowym, Difin, Warszawa 2012.
2. Matkowski P., Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Wolters Kluwer, Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2006.
3. T.T.Kaczmarek, Zarządzanie ryzykiem w handlu międzynarodowym, Difin, Warszawa 2012.
4. A.Zachorowska, Ryzyko działalności inwestycyjnej przedsiębiorstw, PWE, Warszawa 2006.
5. Ryzyko stabilności Sektora finansowego - sygnały i systemy prewencji,

<b>Bilans nakładu pracy przeciętnego studenta</b>		
<b>Czynność</b>	<b>Czas (godz.)</b>	
1. Udział w zajęciach	30	
2. Samodzielna praca z literaturą	10	
3. Udział w przygotowaniu projektu zaliczeniowego.	15	
4. Zaliczenie wykładu	5	
<b>Obciążenie pracą studenta</b>		
<b>forma aktywności</b>	<b>godzin</b>	<b>ECTS</b>
Łączny nakład pracy	60	2
Zajęcia wymagające bezpośredniego kontaktu z nauczycielem	35	1
Zajęcia o charakterze praktycznym	15	1