

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

I. OGÓLNE INFORMACJE PODSTAWOWE O PRZEDMIOCIE (MODULE)											
Modelowanie i raportowanie ryzyka finansowego											
Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej kierunek:				Collegium Humanum Szkoła Główna Menedżerska w Warszawie Filia w.....							
Nazwa kierunku studiów, poziom kształcenia:				ZARZĄDZANIE, studia II stopnia							
Liczba punktów ECTS				3							
Język przedmiotu- polski, angielski, inny				polski							
Profil kształcenia:				PRAKTYCZNY							
Nazwa specjalności:				Zarządzanie ryzykiem w finansach							
Rodzaj modułu kształcenia: (wskazać właściwe)				Podstawowy / kierunkowy/ <u>specjalnościowy</u> /obowiązkowy/ fakultatywny							
Rok / Semestr:				II/3							
Osoba koordynująca przedmiot:				Koordynator kierunku							
Wymagania wstępne (wynikające z następstwa przedmiotów):				Przedmioty kierunkowe z semestrów 1-2							
II. FORMY ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH ORAZ WYMIAR GODZIN											
	Wykład	Ćwiczenia/ konwersatorium	Laboratorium	Warsztaty	Projekt	Seminarium	Praktyki	Ko	Egzamin / zaliczenie	Suma godzin	Ogółem ECTS
Studia stacjonarne		50			6			4	2	62	3
Studia niestacjonarne		20			6			4	3	33	3
III. METODY REALIZACJI ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH											
Formy zajęć				Metody dydaktyczne (właściwe podkreślić)							
Wykład/Ćwiczenia/Warsztat/ <u>Projekt/Laboratorium</u>				Wykład z dyskusją ukierunkowaną wykład z prezentacją multimedialną <u>case study.</u> <u>metoda sytuacyjna.</u> <u>metoda projektów.</u> <u>dyskusja dydaktyczna.</u> <u>Ćwiczenia rachunkowe</u> Ćwiczenia z wykorzystaniem narzędzi informatycznych - edukacyjna gra Gra symulacyjna Drama Inne							
IV. PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ Z ODNIESIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKU											
Lp.	Opis przedmiotowych efektów uczenia się									Odniesienie do efektu kierunkowego symbol	
Wiedza:											
P_W01	Ma wiedzę na temat procesu zarządzania ryzykiem									K2P_W01, K2P_W04, K2P_W07	

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

P_W02	Ma zaawansowaną wiedzę na temat modelowania ryzyka	K2P_W01, K2P_W04, K2P_W07
P_W03	Ma wiedzę na temat raportowania ryzyka	K2P_W01, K2P_W03, K2P_W04, K2P_W07
Umiejętności:		
P_U01	Posiada umiejętności w zakresie wyboru i zastosowania modeli ryzyka, a także - w uproszczonych stylizowanych przypadkach - tworzenia własnych modeli ryzyka	K2P_U01, K2P_U07
P_U02	Posiada umiejętności raportowania ryzyka i określania kapitału adekwatnego na potrzeby własne instytucji oraz na potrzeby raportowania do organów nadzorczych	K2P_U01, K2P_U07
Kompetencje społeczne:		
P_K01	Jest gotów do prezentacji propozycji modelu pomiaru ryzyka oraz propozycji strategii zabezpieczania się przed ryzykiem, a także efektów ich zastosowania	K2P_K01, K2P_K02
P_K02	Jest gotów do samodzielnego poszerzania i pogłębiania swojej wiedzy oraz doskonalenia umiejętności w zakresie modelowania ryzyka, weryfikacji modelu ryzyka, sterowania ryzykiem oraz raportowania ryzyka dla różnych rodzajów instrumentów finansowych i ich portfeli oraz różnych rodzajów ryzyka	K2P_K01, K2P_K02
P_K03	Jest gotów do rozumienia znaczenia ryzyka w podejmowaniu decyzji finansowych, zagrożeń wynikających z niedoszacowania ryzyka lub jego ignorowania, a także potrzeby unikania przeszacowania ryzyka, wyciągania praktycznych wniosków ze swojej wiedzy w tym zakresie i jej prezentacji	K2P_K01, K2P_K02
P_K04	Jest gotów do rozumienia znaczenia i potrzeby przestrzegania etyki zawodowej w obszarze zarządzania ryzykiem	K2P_K02
V. TREŚCI KSZTAŁCENIA		
Lp.	Ćwiczenia/Projekt/Laboratorium (właściwe wybrać)	Odniesienie do przedmiotowych efektów uczenia się
T1	Przypomnienie i poszerzenie wiedzy na temat pojęcia i definicji ryzyka, procesu zarządzania nim oraz relacji między teorią ryzyka a innymi obszarami w ramach dyscypliny finanse	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T2	Powtórzenie i rozszerzenie materiału w zakresie ryzyka rynkowego i jego miar	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T3	Zaawansowane metody weryfikacji modelu wartości zagrożonej (back-testing)	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T4	Raportowanie ryzyka rynkowego, wyznaczenie kapitału adekwatnego z tytułu ryzyka rynkowego i regulacje w tym zakresie	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T5	Ryzyko kredytowe, ryzyko operacyjne i wybrane inne rodzaje ryzyka - modele, raportowanie oraz kontekst regulacyjny	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T6	Elementy zintegrowanego pomiaru i raportowania ryzyka	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
T7	Analiza ryzyka systemowego wraz z kontekstem regulacyjnym	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
P1	Case studies	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04
VI. METODY WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ		

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

Forma zajęć, w ramach której weryfikowany jest EU	Metoda weryfikacji (WŁAŚCIWE WYBRAĆ) Egzamin pisemny, egzamin ustny, kolokwium, projekt, prezentacja, referat, esej inne	Kategoria weryfikowanych efektów uczenia się: wiedza, umiejętności, kompetencje społeczne WŁAŚCIWE WYBRAĆ	
Ćwiczenia	Praca zaliczeniowa	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04	
Zajęcia projektowe	Projekt – case studies	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04	
WARUNKI ZALICZENIA PRZEDMIOTU wskazać właściwe			
	Zaliczenie wszystkich form zajęć przedmiotu (Ćwiczeń, projektu, laboratorium, pozytywna ocena egzaminu, INNE		
Ćwiczenia	Pozytywnie zaliczona praca pisemna	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04	
Zajęcia projektowe	Pozytywnie zaliczony projekt, ocena pracy w grupie,	P_W01-P_W03 P_U01-P_U02, P_K01_P_K04	
VIII. NAKŁAD PRACY STUDENTA – WYMIAR GODZIN I BILANS PUNKTÓW ECTS			
Rodzaj aktywności ECTS	Obciążenie studenta		
	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne	
1. Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów dydaktycznych (wykłady, ćwiczenia, konwersatoria, projekt, laboratoria, warsztaty, seminaria) – SUMA godzin – z punktu II	62	33	
W tym			
1.1. Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów	56	26	
1.2. Egzaminy/zaliczenia -liczba godzin	2	3	
1.3. Udział w konsultacjach -liczba godzin	4	4	
2. Indywidualna praca własna studenta - liczba godzin – Projekt / esej / studium przypadku / zadanie praktyczne, samodzielne przygotowanie się do zajęć, egzaminów, zaliczeń	13	42	
Sumaryczne obciążenie pracą studenta (25h = 1 ECTS) SUMA godzin i ECTS	75/3	75/3	
IX. LITERATURA PRZEDMIOTU ORAZ INNE MATERIAŁY DYDAKTYCZNE			
Literatura podstawowa przedmiotu:			
Krawczyk T., 2022, Modelowanie ryzyka inwestycyjnego, CeDeWu			
Doman R., Doman M., 2009, Modelowanie zmienności i ryzyka. Metody ekonometrii finansowej. Wolters Kluwer Polska S.A.			
Literatura uzupełniająca przedmiotu:			
Zarządzanie ryzykiem, Jajuga K. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2009			
Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowej, Hull J.C., Wydawnictwa Profesjonalne PWN, Warszawa, 2011			
Pomiar ryzyka przedsiębiorstwa. Modele pomiaru i ich ryzyko, Kuziak K. Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, Wrocław, 2011			
Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Jajuga K., Jajuga T. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2006			
Ryzyko kredytowe, Krysiak Z., Oficyna Ekonomiczna, Kraków, 2006			
Zarządzanie ryzykiem operacyjnym, Matkowski P., Wolters Kluwer, Warszawa, 2006			

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

Inne materiały dydaktyczne: