



Przedmiot: Ryzyko w działalności gospodarczej				
Forma zajęć: ćwiczenia	Semestr: 4	Rok: 2	Wymiar godzin: 15	Punkty ECTS:
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: do wyboru		Język nauczania: polski
Kierunek: Ekonomia			Tryb: stacjonarne	Rodzaj: licencjackie
Specjalność: Analityk rynku				
Katedra: Katedra Ekonomii Matematycznej				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Radosław Kurach		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Mikroekonomia, Statystyka

Program przedmiotu:

1. Podstawy pomiaru ryzyka
2. Identyfikacja rodzajów ryzyka
3. Ryzyko rynkowe - miary ryzyka, hedging z wykorzystaniem instrumentów pochodnych
4. Ryzyko kredytowe - podstawowe kategorie wykorzystywane w zarządzaniu ryzykiem kredytowym, rozkłady ryzyka kredytowego

Metody dydaktyczne:

Rozwiązywanie list zadań służących utrwaleniu materiału prezentowanego w ramach wykładu.

Cele przedmiotu:

Zapoznanie studentów z podstawami procesu zarządzania ryzykiem, w szczególności metodami pomiaru oraz sposobami zabezpieczenia się przed różnymi rodzajami ryzyka.

Warunki zaliczenia:

Kolokwium końcowe w formie testu jednokrotnego wyboru.

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P. (1997), Inwestycje finansowe, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego.
2. Jajuga K., Jajuga T. (2006), Inwestycje – instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Wydawnictwo Naukowe PWN.
3. Jajuga K. (red nauk.) (2007), Zarządzanie ryzykiem, Wydawnictwo Naukowe PWN.

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Riehl H. (2001), Zarządzanie ryzykiem na rynku pieniężnym walutowym i instrumentów pochodnych, Warszawski Instytut Bankowości.