

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Portfolio and Risk Management, PG_00177644						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2025 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2026/2027		
Poziom kształcenia	II stopnia		Grupa zajęć		Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów Grupa zajęć fakultatywnych Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	2		Język wykładowy		angielski		
Semestr studiów	3		Liczba punktów ECTS		5.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Rektor -> Wydział Zarządzania -> Katedra Finansów Przedsiębiorstw						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr hab. Ewa Majerowska				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	30.0	15.0	0.0	0.0	60
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów		Udział w konsultacjach		Praca własna studenta	RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	60		4.0		61.0	125
Cel przedmiotu	Celem kursu jest zapoznanie studentów z teoretycznymi i praktycznymi zagadnieniami zarządzania ryzykiem w finansach. Ma on również przygotować studentów do identyfikowania czynników wpływających na zwroty aktywów i analizowania ryzyka aktywów. Studenci uczą się jak stosować strukturę stóp zwrotu, aby konstruować najlepsze portfele i jak używać wskaźników efektywności, aby oceniać wyniki portfela.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRMU2_K03] Student jest gotów do myślenia i działania w sposób przedsiębiorczy i odpowiedzialny oraz do inicjowania, koordynowania i uczestnictwa w projektach na rzecz środowiska społecznego oraz interesu publicznego, a także inspirowania innych w tym obszarze - z perspektywy finansów i rachunkowości.	Student jest przygotowany do samodzielnego działania oraz myślenia i działania w sposób odpowiedzialny, uwzględniający proponowane działania w zakresie zarządzania ryzykiem i inwestowania. Jest przygotowany do uczestnictwa w projektach mających na celu podejmowanie właściwych decyzji ekonomicznych z punktu widzenia zarządzania finansami.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_K02] Student jest gotów do odpowiedzialnego pełnienia ról zawodowych, przestrzegania i rozwijania zasad etyki zawodowej oraz działania na rzecz ich przestrzegania, a także do dbałości o rozwój dorobku oraz podtrzymywanie etosu i tradycji zawodów związanych z finansami i rachunkowością.	Student jest przygotowany do podjęcia pracy w dziedzinie zarządzania finansami i zarządzania ryzykiem z odpowiedzialnością i zrozumieniem. Student jest zobowiązany do wspierania osiągnięć zawodów związanych z finansami.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja
	[FiRMU2_U02] Student potrafi proponować lub projektować adekwatne rozwiązania (w tym innowacyjne) złożonych problemów z zakresu finansów i rachunkowości.	Student potrafi zaproponować dobór odpowiednich instrumentów w procesie zarządzania ryzykiem. Potrafi uwzględnić złożoność procesów i projektować rozwiązania wykorzystując poznane narzędzia.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_U12] Student potrafi wykorzystywać technologie i systemy informatyczne (w tym zaawansowane), wspomagające pracę zawodową w obszarze finansów i rachunkowości.	Student potrafi posługiwać się zaawansowanymi systemami informatycznymi wspomagającymi pracę zawodową w obszarze zarządzania ryzykiem i tworzenia portfeli inwestycyjnych.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_W06] Student w pogłębionym stopniu zna i rozumie cele, istotę, charakter i wzajemne powiązania procesów finansowych, sposobów ich ewidencji oraz zasady racjonalnego podejmowania decyzji, ze szczególnym uwzględnieniem decyzji o charakterze strategicznym, a także wdrażania zmian w tym zakresie.	Student ma zaawansowaną wiedzę na temat natury powiązań między procesami mającymi na celu zarządzanie ryzykiem. Posiada wiedzę na temat racjonalnego podejmowania decyzji, zwłaszcza w odniesieniu do optymalizacji portfela inwestycyjnego.	[SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_W05] Student w pogłębionym stopniu zna i rozumie zaawansowane (w tym innowacyjne) metody, narzędzia oraz techniki pozyskiwania, wykorzystania i analizy danych niezbędnych do oceny sytuacji finansowej różnych podmiotów w obszarze nauk o zarządzaniu i jakości oraz ekonomii i finansów.	Student posiada wszechstronną wiedzę na temat zarządzania ryzykiem w różnych obszarach gospodarczych i narzędzi służących do jego analizy. Posiada wiedzę na temat istoty i metod tworzenia portfeli inwestycyjnych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_W08] Student w pogłębionym stopniu zna i rozumie złożoność powiązań rachunkowości i finansów z działalnością gospodarczą w warunkach dynamicznie zmieniającego się otoczenia oraz towarzyszące im współczesne wyzwania i dylematy w tym kontekście.	Student posiada zaawansowaną wiedzę z zakresu zarządzania ryzykiem w dynamicznie zmieniającym się otoczeniu gospodarczym oraz optymalizacji decyzji gospodarczych w świetle wyzwań współczesnego rynku.	[SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport

Treści przedmiotu	1. Podstawy ryzyka. 2. Pomiar i zarządzanie ryzykiem. 3. Zarządzanie ryzykiem. 5. Zarządzanie ryzykiem kredytowym. 6. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym. 7. Zarządzanie ryzykiem przedsiębiorstwa. 8. Zarządzanie ryzykiem ubezpieczeniowym. 9. Proces zarządzania portfelem i oświadczenie o polityce inwestycyjnej: perspektywa portfela, zarządzanie portfelem jako proces, cele inwestycyjne i ograniczenia. 10. Zarządzanie portfelami inwestorów instytucjonalnych: fundusze emerytalne, branża ubezpieczeniowa, banki i inni inwestorzy instytucjonalni. 11. Oczekiwania rynku kapitałowego: oczekiwania rynku kapitałowego, analiza ekonomiczna. 12. Alokacja aktywów: cele inwestora dotyczące ryzyka i zwrotu, wybór klas aktywów, optymalizacja. 13. Monitorowanie i rebalancing: monitorowanie portfela, rebalancing portfela. 14. Ocena wydajności portfela: składniki oceny wydajności, pomiar wydajności, atrybucja wydajności, ocena wydajności.		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Student powinien posiadać podstawową wiedzę z zakresu bankowości i sprawozdawczości finansowej. Wymagana jest również znajomość podstaw statystyki. Statystyka opisowa i statystyka inferencyjna, instrumenty rynku finansowego.		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Projekt	51.0%	50.0%
	Zaliczenie pisemne	51.0%	50.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	1. Rejda G.E., McNamara M., Principles of Risk Management and Insurance, 13th edition, Pearson 2017 2. Dorfman M.S., Cather D.A., Introduction to Risk Management and Insurance (10th Edition), Pearson 2013 3. Elton, E. J, Gruber, M. J., Brown, S. J, and W. N. Goetzmann, Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, JohnWiley and Sons, 8th edition, 2010 4. Hull J.C., Risk Management and Financial Institutions, John Wiley & Sons, 2012 5. Jorion P., Financial Risk Manager Handbook (3rd edition), Wiley, 2005 6. Maggin J.L., Tuttle D.L., McLeavey D.W., and Pinto J.E., Managing Investment Portfolio. A Dynamic Process, John Wiley & Sons, 2007	
	Uzupełniająca lista lektur	1. Bacon C.R., Practical Portfolio Performance Measurement and Attribution, 2nd Edition, John Wiley & Sons, 2008 2. Madura J., Fox R., International financial management, 2017	
	Adresy eZasobów		
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	1. Wyjaśnij ideę zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie. 2. Przedstaw metody optymalizacji portfela.		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.