

**Karta przedmiotu**

Nazwa i kod przedmiotu	Portfolio and Risk Management, PG_00177644						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2026 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2027/2028		
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_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_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_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/diskusja [SU2] 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/diskusja
	[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/diskusja [SK2] 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/diskusja [SW2] prezentacja/projekt/referat/raport

Treści przedmiotu	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Podstawy ryzyka.</li> <li>2. Pomiar i zarządzanie ryzykiem.</li> <li>3. Zarządzanie ryzykiem.</li> <li>5. Zarządzanie ryzykiem kredytowym.</li> <li>6. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym.</li> <li>7. Zarządzanie ryzykiem przedsiębiorstwa.</li> <li>8. Zarządzanie ryzykiem ubezpieczeniowym.</li> <li>9. Proces zarządzania portfelem i oświadczenie o polityce inwestycyjnej: perspektywa portfela, zarządzanie portfelem jako proces, cele inwestycyjne i ograniczenia.</li> <li>10. Zarządzanie portfelami inwestorów instytucjonalnych: fundusze emerytalne, branża ubezpieczeniowa, banki i inni inwestorzy instytucjonalni.</li> <li>11. Oczekiwania rynku kapitałowego: oczekiwania rynku kapitałowego, analiza ekonomiczna.</li> <li>12. Alokacja aktywów: cele inwestora dotyczące ryzyka i zwrotu, wybór klas aktywów, optymalizacja.</li> <li>13. Monitorowanie i rebalancing: monitorowanie portfela, rebalancing portfela.</li> <li>14. Ocena wydajności portfela: składniki oceny wydajności, pomiar wydajności, atrybucja wydajności, ocena wydajności.</li> </ol>		
Wymagania wstępne i dodatkowe	<p>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.</p>		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Zaliczenie pisemne	51.0%	50.0%
	Projekt	51.0%	50.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Rejda G.E., McNamara M., Principles of Risk Management and Insurance, 13th edition, Pearson 2017</li> <li>2. Dorfman M.S., Cather D.A., Introduction to Risk Management and Insurance (10th Edition), Pearson 2013</li> <li>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</li> <li>4. Hull J.C., Risk Management and Financial Institutions, John Wiley &amp; Sons, 2012</li> <li>5. Jorion P., Financial Risk Manager Handbook (3rd edition), Wiley, 2005</li> <li>6. Maggin J.L., Tuttle D.L., McLeavey D.W., and Pinto J.E., Managing Investment Portfolio. A Dynamic Process, John Wiley &amp; Sons, 2007</li> </ol>	
	Uzupełniająca lista lektur	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Bacon C.R., Practical Portfolio Performance Measurement and Attribution, 2nd Edition, John Wiley &amp; Sons, 2008</li> <li>2. Madura J., Fox R., International financial management, 2017</li> </ol>	
	Adresy eZasobów		
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Wyjaśnij ideę zarządzania ryzykiem w przedsiębiorstwie.</li> <li>2. Przedstaw metody optymalizacji portfela.</li> </ol>		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.