

ZARZĄDZANIE RYZYKIEM

Risk Management

NAZWA PRZEDMIOTU	ZARZĄDZANIE RYZYKIEM
Kierunek studiów	NIERUCHOMOŚCI I INWESTYCJE
Rok i semestr studiów	Rok III, Semestr 6
Poziom kształcenia	I stopień
Profil kształcenia na kierunku	Ogólnoakademicki
Moduł kształcenia dla przedmiotu	Kierunkowy
Przedmiot z polskiego minimum programowego	RzM-II.5
Przedmiot z minimum programowego RICS	V5, V7, V9; V10; PFI 1, PFI 3, PFI 10
Status przedmiotu	Obligatoryjny

Forma zajęć	Liczba godzin		ECTS	Forma zaliczenia
	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne		
Wykłady	30	16	3	Egzamin
Razem za zajęcia dydaktyczne	30	16		
Konsultacje, egzaminy i zaliczenia	10	10		
Razem z udziałem nauczyciela	40	26		
Praca własna studenta	35	49		
Ogółem	75	75		

Wymagania wstępne (wynikające z następstwa przedmiotów)

Rynki finansowe; Finanse przedsiębiorstwa; Matematyka finansowa; Statystyka opisowa

Cele kształcenia dla przedmiotu

1	Zapoznanie z podstawami oceny i pomiaru ryzyka.
2	Ukształtowanie umiejętności zastosowania matematyki finansowej do wyceny instrumentów finansowych służących zarządzaniu ryzykiem.
3	Charakterystyka metod opracowania oraz prezentowania danych ekonometrycznych w procesie zarządzania ryzykiem.

Efekty uczenia się

WIEDZA			
L.p.	Efekty przedmiotowe (Student zna i rozumie)	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się	Metody weryfikacji efektów uczenia się
W1	Student zna struktury i podmioty działające w gospodarce oraz procesy zachodzące między nimi w kontekście ryzyka rynkowego.	NI_WG04	Egzamin
W2	Student zna metody wspomagania decyzji oraz zastosowanie metod ilościowych w zarządzaniu ryzykiem nieruchomości.	NI_WG14	Egzamin
W3	Student posiada wiedzę o metodach analizy i sterowania ryzykiem ekonomicznym w sektorze nieruchomości i finansów.	NI_WG15	Egzamin
W4	Student zna terminologię, teorie i metody zarządzania ryzykiem, obejmujące zastosowania badawcze i praktyczne.	NI_WG18	Egzamin
UMIĘJĘTNOŚCI			
L.p.	Efekty przedmiotowe (Student potrafi)	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się	Metody weryfikacji efektów uczenia się
U1	Student potrafi przygotować prace pisemne oraz wystąpienia dotyczące oceny ryzyka inwestycyjnego na podstawie zdobytej wiedzy.	NI_UW07	Egzamin
KOMPETENCJE SPOŁECZNE			
L.p.	Efekty przedmiotowe (Student jest gotów do)	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się	Metody weryfikacji efektów uczenia się
K1	Student jest gotowy myśleć i działać w sposób przedsiębiorczy, przewidując konsekwencje ryzyka w procesach inwestycyjnych.	NI_KO04	Udział w dyskusji
K2	Student zdaje sobie sprawę z konsekwencji środowiskowych i społecznych wynikających z decyzji obciążonych ryzykiem.	NI_KR01	Udział w dyskusji

Treści kształcenia

L.p.	Treść kształcenia (tematyka zajęć)	Liczba godzin			
		Wykłady		Ćwiczenia	
		Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
1	Ryzyko inwestycji - podstawowe pojęcia. Definicja ryzyka inwestycji. Rodzaje ryzyka inwestycji i określenie warunków szczególnych dla każdego rodzaju ryzyka.	3	2		
2	Statystyczne wyznaczanie wysokości ryzyka. Teoretyczne podstawy pomiaru ryzyka. Miary ryzyka wynikające z rozkładu statystycznego zmiennej ryzyka. Miary zmienności. Kwantyle rozkładu. Wartości dystrybuanty rozkładu. Koncepcja miar wrażliwości. Miary zmienności.	3	2		
3	Kontrakty terminowe - charakterystyka, zasady obrotu, sposób wyceny i zastosowanie w hedgingu, arbitrażu oraz spekulacji.	6	3		
4	Opcje - charakterystyka, zasady obrotu, zastosowanie w arbitrażu, spekulacji oraz zarządzaniu ryzykiem.	6	2		
5	Opcje - sposoby wyceny, alfabet grecki dla współczynników kształtujących wycenę opcji.	3	2		
6	Swapy - charakterystyka, zasady obrotu i sposoby wyceny.	6	3		
7	Krótką sprzedaż jako forma inwestowania na rynku.	3	2		
	Razem	30	16		

Metody kształcenia

Metoda kształcenia	Forma zajęć	
	Wykłady	Ćwiczenia
Wykład informacyjny i/lub problemowy z prezentacją multimedialną	X	
Wykład konwersatoryjny		
Analiza przypadków i przykładów	X	
Dyskusja, debata, burza mózgów, grywalizacja itp.	X	
Rozwiązywanie zadań, ćwiczenia zespołowe, ćwiczenia laboratoryjne		
Projektowanie, programowanie, symulacje		
Inne:		

Warunki zaliczenia

Sposób zaliczenia	Wagi (%)	
	Wykłady	Ćwiczenia
Egzamin ustny		
Egzamin pisemny	100	100
Kolokwium		
Przygotowanie i przedstawienie eseju / referatu / innej formy wypowiedzi pisemnej		
Wykonanie zadań / ćwiczeń / projektu podczas zajęć		
Wykonanie zadań / ćwiczeń / projektu poza zajęciami		
Wypowiedzi ustne podczas zajęć (np. w trakcie dyskusji, debaty)		
Inny (jaki?)		
Razem	100	100

Rozliczenie pracy własnej studenta

L.p.	Czynności w ramach pracy własnej	Szacowana liczba godzin	
		Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
1	Przygotowanie do udziału w zajęciach (np. wstępna lektura, przygotowanie lub zgromadzenie materiałów, pomocy naukowych, przygotowanie referatu lub prezentacji na zajęcia itp.)	10	14
2	Wykonanie ćwiczeń lub zadań po zajęciach (jako utrwalenie lub rozszerzenie treści z odbytych zajęć)		
3	Realizacja zadania projektowego poza zajęciami		

4	Przygotowanie pracy pisemnej poza zajęciami		
5	Lektura obowiązkowa	10	15
6	Obowiązkowe zapoznanie się z innymi materiałami lub treściami (np. materiałami audio, wideo, narzędziami, pomocami, oprogramowaniem, sprzętem, aktami prawnymi, dokumentacją, warunkami miejsca pracy itp.)	5	10
6	Przygotowanie do kolokwium		
7	Przygotowanie do egzaminu	10	10
8	Inne (jakie?)		
	Razem	35	49

Literatura obowiązkowa

1	Bućko, J. (2021). <i>Planowanie biznesowe i zarządzanie ryzykiem projektów</i> . Wydawnictwo Politechniki Świętokrzyskiej.
2	Jajuga, K. (2009). <i>Zarządzanie ryzykiem</i> . Wydawnictwo Naukowe PWN.
3	Tarczyński, W., & Mojsiewicz, M. (2001). <i>Zarządzanie ryzykiem</i> . Poltext.
4	Solarz, J. K., & Waliszewski, K. (2020). <i>Całościowe zarządzanie ryzykiem systemowym: pandemia COVID- 19</i> . edu-Libri.

Literatura uzupełniająca

1	Bogdanienko, J. (2022). <i>Ryzyko i kryzys w procesie rozwoju organizacji</i> . CeDeWu
2	Chodyński, A. (2024). <i>Wpływ koncepcji zarządzania na architekturę bezpieczeństwa biznesu – programy zapobiegania awariom przemysłowym</i> . Bezpieczeństwo. Teoria i Praktyka, (1), 77–91.
3	Giszterowicz, A. (2022). <i>Operationalising a Safety Culture in The Management of a Business Entity (Case Study)</i> . Bezpieczeństwo. Teoria i Praktyka, (2), 91–102.
4	Jajuga, K., & Jajuga, T. (2024). <i>Investycje: Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa</i> . Wydawnictwo Naukowe PWN.
5	Chodyński, A. (2022). <i>Kryzys pozakonomiczny przedsiębiorstwa – ekologiczny aspekt rezilencji organizacyjnej</i> . W: A. Chodyński, D. Fatuła, & M. Leśniewski (red.), <i>Zrównoważony rozwój, systemy informacyjne i zarządzanie bezpieczeństwem w perspektywie długoterminowej przedsiębiorstw</i> (s. 11–31). Oficyna Wydawnicza AFM.
6	Chugaievska, S., & Wisła, R. (2023). <i>A new wave of migration in Ukraine on the background of Russian invasion: dynamics, challenges and risks</i> . Journal of International Studies, 16(4), 220–244.
7	du Vall, M. (2020). <i>Zarządzanie informacją przez instytucje publiczne – studium przypadku komunikacji kryzysowej Ministerstwa Zdrowia via Twitter w okresie pandemii</i> . Bezpieczeństwo. Teoria i Praktyka.
8	Hull, J. C. (2023). <i>Opcje, kontrakty terminowe i inne instrumenty pochodne</i> (11. wyd.). Wydawnictwo Naukowe PWN.
9	Waśniewski, K. (2025). <i>Small Modular Reactors in Poland: Financial risks and constraints in a radically innovative megaproject</i> . In A. Jabłoński & M. Jabłoński (Eds.), <i>Climate Changing Processes: Strategic Perspectives</i> (1st ed.).
10	Royal Institution of Chartered Surveyors. (2022). <i>Risk, liability and insurance</i> (1st ed.). RICS Professional Standard.

Inne materiały dydaktyczne

1	Przykłady i zadania omawiane podczas zajęć
2	Prezentacje z zajęć