

Metody ilościowe i jakościowe oceny ryzyka

WZ

Zarządzanie i inżynieria produkcji
Studia II stopnia o profilu: A ■ P □



Przedmiot: Metody ilościowe i jakościowe oceny ryzyka		Kod przedmiotu ZIP 1 S 02 44-4_0
Status przedmiotu:		Przedmiot obowiązkowy
Język wykładowy:		Język polski
Rok: II		Semestr: II
Nazwa specjalności:	Zarządzanie przedsiębiorstwem	
Rodzaj zajęć i liczba godzin:	Studia stacjonarne	
Wykład	15	
Ćwiczenia	-	
Laboratorium	-	
Projekt	-	
Seminarium	30	
Liczba punktów ECTS:	3	

Cel przedmiotu	
C1	Omówienie podstawowych narzędzi identyfikacji ryzyka
C2	Zapoznanie studentów z metodami redukcji ryzyka
C3	Zapoznanie studentów z zastosowaniem teorii ryzyka do podejmowania optymalnych decyzji w życiu gospodarczym.

Wymagania wstępne w zakresie wiedzy, umiejętności i innych kompetencji	
1	Matematyka
2	Statystyka
3	Prognozowanie i symulacje w przedsiębiorstwie
4	Badania operacyjne

Efekty kształcenia	
	W zakresie wiedzy:
EK1	Identyfikuje i rozumie złożone procesy oraz zjawiska zachodzące w organizacjach i w otaczającym je świecie, interdyscyplinarne poglądy na ich temat i ewolucję, oraz relacje zachodzące między nimi, ich uwarunkowania i kierunki zmian.
EK2	Zna specjalistyczne zastosowania zaawansowanych metod statystycznych i matematycznych w zakresie prognozowania zjawisk oraz narzędzi informatycznych gromadzenia, analizy i prezentacji danych, a także wspomaganie decyzji zarządczych.
	W zakresie umiejętności:
EK3	Potrafi ocenić wpływ uwarunkowań zewnętrznych i wewnętrznych na procesy inżynierii produkcji i zarządzania oraz przygotowywać i podejmować decyzje zarządcze, zwłaszcza strategiczne z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi wspomagających procesy podejmowania decyzji.
EK4	Dokonyuje obserwacji wybranych zjawisk i procesów w organizacji oraz jej otoczeniu, a także ich analizy i interpretacji przy zastosowaniu zaawansowanych ujęć teoretycznych.
	W zakresie kompetencji społecznych:
EK5	Ma świadomość poziomu swojej wiedzy i umiejętności, rozumie potrzebę dokończenia się.

Treści programowe przedmiotu		
Forma zajęć – wykłady		
	Treści programowe	Liczba godzin
W1	Zarządzanie ryzykiem. Wprowadzenie, podstawowe pojęcia.	1
W2	Ryzyko w działalności gospodarczej.	1
W3	Koszt ryzyka jako składnik funkcji kosztów.	1

W4	Ryzyko na rynku kapitałowym. Identyfikacja ryzyk rynkowego, walutowego i operacyjnego.	1
W5	Identyfikacja ryzyka kredytowego.	1
W6	Identyfikacja ryzyka zawodowego.	1
W7	Analiza ryzyka wielowymiarowego.	1
W8	Techniki redukcji ryzyka. Dywersyfikacja ryzyka.	1
W9	Ubezpieczenie ryzyka.	1
W10	Zakup informacji a redukcja ryzyka.	1
W11	Wycena wartości informacji.	1
W12	Cechy podatności. Podatność a ryzyko. Konstruowanie profili ryzyka.	1
W13	Wyznaczanie stref bezpieczeństwa.	1
W14	Określanie akceptowalności ryzyka w oparciu o probabilistyczne modele zagrożeń.	1
W15	Redukcja ryzyka w modelach planistycznych i operacyjnych.	1
	Suma godzin:	15
Forma zajęć – laboratoria		
	Treści programowe	Liczba godzin
L1	Omówienie technik obliczeniowych. Identyfikacja rozkładów zmiennych losowych.	2
L2	Koszt ryzyka jako składnik funkcji kosztów.	2
L3	Ryzyko na rynku kapitałowym.	2
L4	Identyfikacja ryzyk rynkowego, walutowego i operacyjnego.	2
L5	Identyfikacja ryzyka kredytowego.	2
L6	Identyfikacja ryzyka zawodowego.	2
L7	Analiza ryzyka wielowymiarowego.	2
L8	Techniki redukcji ryzyka. Dywersyfikacja ryzyka.	2
L9	Ubezpieczenie ryzyka.	2
L10	Zakup informacji a redukcja ryzyka.	2
L11	Wycena wartości informacji.	2
L12	Cechy podatności. Podatność a ryzyko. Konstruowanie profili ryzyka.	2
L13	Wyznaczanie stref bezpieczeństwa.	2
L14	Określanie akceptowalności ryzyka w oparciu o probabilistyczne modele zagrożeń.	2
L15	Redukcja ryzyka w modelach planistycznych i operacyjnych.	2
	Suma godzin:	30

Narzędzia dydaktyczne	
1	Wykład
2	Ćwiczenia laboratoryjne

Sposoby oceny	
Ocena formująca	
F1	Rozwiązywanie zadań, przykładów ze wspólnym omówieniem wyników
Ocena podsumowująca	
P1	Zaliczenie pisemne
P2	Egzamin pisemny

Obciążenie pracą studenta	
Forma aktywności	Średnia liczba godzin na zrealizowanie aktywności
Godziny kontaktowe z wykładowcą, realizowane w formie zajęć dydaktycznych – łączna liczba godzin w semestrze	45
Przygotowanie się do laboratorium – łączna liczba godzin w semestrze	Metody ilościowe i jakościowe oceny ryzyka
Przygotowanie się do zajęć – łączna liczba godzin w semestrze	15

Suma	75
Sumaryczna liczba punktów ECTS dla przedmiotu	3

Literatura podstawowa i uzupełniająca	
1	T. Banek, Rachunek ryzyka, Wyd. PL, Lublin 2000.
2	A. Zachorowska, Ryzyko działalności inwestycyjnej przedsiębiorstw, Warszawa 2006.
3	K. Jajuga, T. Jajuga, Inwestycje, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2004.
4	W. Rogowski, A. Michalczewski, Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwach inwestycyjnych, Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2005.
5	A. Saunders, Metody pomiaru ryzyka kredytowego, Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2001.
6	I. Romanowska, A. Słomka, Ryzyko zawodowe. Procedury. Metody. Zagrożenia, OS PIP, Wrocław 2001.
7	E. Ostrowska, Ryzyko projektów inwestycyjnych, PWE, Warszawa 2002.
8	A. Karczowski, Zarządzanie ryzykiem w projektach informatycznych. Teoria i praktyka, Helion, Warszawa 2009.

Macierz efektów kształcenia					
Efekt kształcenia	Odniesienie danego efektu kształcenia do efektów zdefiniowanych dla całego programu (PEK)	Cele przedmiotu	Treści programowe	Narzędzia dydaktyczne	Sposób oceny
EK1	ZIP2A_W14++	C1	W1,W2, W4,W8,W12 L1,L2,L4,L8,L12	1, 2	F1, P1, P2
EK2	ZIP2A_W17+++	C2,C3	W4- W7,W11, W14,W15 L4- L7,L11, L14,L15	1, 2	F1, P1, P2
EK3	ZIP2A_U04+++	C1,C2	W2,W7- W15, L2,L7- L15	1, 2	F1, P1, P2
EK4	ZIP2A_U17++	C1,C2	W3,W12- W14, L3,L12- L14	1, 2	F1, P1, P2
EK5	ZIP2A_K11+	C2,C3	W4,W8,W14,W15, L4,L8,L14, L15	1, 2	F1, P1, P2

Formy oceny – szczegóły				
	Na ocenę 2 (ndst)	Na ocenę 3 (dst)	Na ocenę 4 (db)	Na ocenę 5 (bdb)
EK1	Nie zna podstawowych czynników oraz modeli identyfikacji i redukcji ryzyka w działalności gospodarczej.	Zna podstawowe czynniki oraz modele identyfikacji i redukcji ryzyka w działalności gospodarczej.	Zna podstawowe czynniki oraz potrafi ogólnie zastosować modele identyfikacji i redukcji ryzyka w działalności gospodarczej.	Zna podstawowe czynniki oraz potrafi w sposób wyczerpujący zastosować modele identyfikacji i redukcji ryzyka w działalności gospodarczej.
EK2	Nie umie stosować klasycznych metod identyfikacji ryzyka.	Potrafi określić klasyczne metody identyfikacji ryzyka.	Zna oraz potrafi ogólnie zastosować klasyczne metody identyfikacji ryzyka.	Zna oraz potrafi w sposób wyczerpujący zastosować klasyczne metody identyfikacji ryzyka.
EK3	Nie umie stosować klasycznych metod redukcji ryzyka.	Potrafi określić klasyczne metody redukcji ryzyka.	Zna oraz potrafi ogólnie zastosować klasyczne metody redukcji ryzyka.	Zna oraz potrafi w sposób wyczerpujący zastosować klasyczne metody redukcji ryzyka.

EK4	Nie potrafi wyznaczyć profili ryzyka i stref bezpieczeństwa	Zna metody wyznaczania profili ryzyka i stref bezpieczeństwa	Zna oraz potrafi ogólnie zastosować metody wyznaczania profili ryzyka i stref bezpieczeństwa	Zna oraz potrafi w sposób wyczerpujący zastosować metody wyznaczania profili ryzyka i stref bezpieczeństwa
EK5	Nie chce wzbogacać swoją wiedzę i umiejętności z zakresu teorii ryzyka	Potrafi częściowo wzbogacać swoją wiedzę i umiejętności z zakresu teorii ryzyka	Potrafi wzbogacać swoją wiedzę i umiejętności z zakresu teorii ryzyka	Potrafi wyczerpująco wzbogacać swoją wiedzę i umiejętności z teorii ryzyka

Autor programu:	Prof. dr hab. inż. T. Banek
Adres e-mail:	t.banek@pollub.pl
Jednostka organizacyjna:	Katedra Metod Ilościowych w Zarządzaniu, Wydział Zarządzania PL
Osoba, osoby prowadzące:	Prof. dr hab. inż. T. Banek, dr P. Kowalik, dr E. Kozłowski, dr T. Warowny, mgr B. Przysucha