|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Wypełnia Zespół Kierunku | Nazwa modułu (bloku przedmiotów): **Moduł wybieralny: EKONOMIKA MENEDŻERSKA** | | | | | | Kod modułu: **D** | |
| Nazwa przedmiotu: **Analiza rynku i zarządzanie ryzykiem** | | | | | | Kod przedmiotu: **31** | |
| Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej przedmiot / moduł: **INSTYTUT EKONOMICZNY** | | | | | | | |
| Nazwa kierunku: **EKONOMIA** | | | | | | | |
| Forma studiów: **SS** | | | Profil kształcenia: **praktyczny** | | | Specjalność: **EM** | |
| Rok / semestr: **III/V** | | | Status przedmiotu /modułu: **obowiązkowy** | | | Język przedmiotu / modułu: **polski** | |
| Forma zajęć | wykład | ćwiczenia | | laboratorium | projekt | seminarium | inne  (wpisać jakie) |
| Wymiar zajęć (godz.) | 15 | 15 | |  | 15 |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| Koordynator przedmiotu / modułu | dr hab. inż. Tomasz Korol, prof. uczelni |
| Prowadzący zajęcia | dr hab. inż. Tomasz Korol, prof. uczelni; dr Oleksandra Oliynychuk |
| Cel kształcenia przedmiotu / modułu | Zapoznanie studentów z rodzajami ryzyka i ich charakterystycznymi cechami, wykształcenie umiejętności oceny ryzyka oraz zapoznanie z metodami prognozowania i zarządzania ryzykiem. Uświadomienie studentom potrzeby badania i analizy rynku. Zapoznanie studentów z metodami analizy rynku, zarówno od strony popytu, jak i podaży. |
| Wymagania wstępne | Analiza finansowa |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **EFEKTY UCZENIA SIĘ** | | |
| Nr efektu uczenia się/ grupy efektów | Opis efektu uczenia się | Kod kierunkowego efektu  uczenia się |
| 01 | Zna i rozumie zasady funkcjonowania podmiotów gospodarki rynkowej w skali mikro- i makroekonomicznej | K1P\_W01 |
| 02 | Zna i rozumie relacje, zależności i wydarzenia zachodzące w środowisku społeczno - gospodarczym | K1P\_W03 |
| 03 | Potrafi analizować różne rodzaje ryzyka występującego w działalności przedsiębiorstw | K1P\_U03 |
| 04 | Potrafi analizować relacje między rynkiem a państwem w kontekście uwarunkowań społecznych, ekonomicznych i politycznych oraz potrafi interpretować zmiany zachodzące w otoczeniu lokalnym i regionalnym. | K1P\_U06 |
| 05 | Angażuje się w różne kreatywne formy zdobywania wiedzy i umiejętności | K1P\_K06 |

|  |
| --- |
| **TREŚCI PROGRAMOWE** |
| Wykład |
| Wprowadzenie; Pojęcie ryzyka; Typologia ryzyka; Podejmowanie decyzji w warunkach ryzyka; Istota, elementy i klasyfikacja rynku; Proces analizy rynku; Metody analizy rynku; Rodzaje metod prognozowania ryzyka w przedsiębiorstwie; Wykorzystanie modeli analizy dyskryminacyjnej; Wykorzystanie modeli logitowych; Wykorzystanie modeli probitowych; Wykorzystanie drzew decyzyjnych; Sztuczna inteligencja w ocenie ryzyka ekonomicznego i finansowego; Przyczyny upadłości spółek; Symptomy upadłości spółek; Podsumowanie. |
| Ćwiczenia |
| Wprowadzenie; Analiza rynku; Identyfikacja, ocena oraz prognoza ryzyka dla wybranych przedsiębiorstw z Polski, UE oraz Stanów Zjednoczonych – case study (przy wykorzystaniu metod przedstawionych w trakcie wykładów). |
| Projekt |
| Wprowadzenie; Wybór dwóch przedsiębiorstw do realizacji projektu (jednego przedsiębiorstwa zagrożonego upadłością oraz jednego o dobrej kondycji finansowej); Przeprowadzenie analizy rynku; Przeprowadzenie prognozy ryzyka ekonomicznego i finansowego dla wybranych firm; Zaproponowanie strategii zarządzania ryzykiem dla badanych spółek; Opracowanie 10letniej trajektorii rozwoju lub upadku dla analizowanych firm. |

|  |  |
| --- | --- |
| Literatura podstawowa | 1. Zioło M., Finanse zrównoważone – rozwój, ryzyko, rynek, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2020. 2. Kubiak J., Mizerka J., Zarządzanie ryzykiem finansowym, IBUK Libra, Poznań 2021, [Zarządzanie ryzykiem finansowym](https://wydawnictwo.ue.poznan.pl/books/978-83-8211-048-7/978-83-8211-048-7.pdf) 3. Gąsiorkiewicz L., Monkiewicz J., Finanse cyfrowe. Perspektywa rynkowa. Oficyna Wydawnicza Politechniki Warszawskiej, Warszawa 2022. |
| Literatura uzupełniająca | 1. Prusak B., Wskaźniki rynku kapitałowego - zastosowanie w wycenach przedsiębiorstw oraz w strategiach inwestycyjnych, Warszawa 2012. 2. Korol T., Nowe podejście do analizy wskaźnikowej w przedsiębiorstwie, Warszawa 2013. 3. Korol T., Systemy ostrzegania przedsiębiorstw przed ryzykiem upadłości, Warszawa 2010. |
| Metody kształcenia stacjonarnego | Wykłady, ćwiczenia i projekt prowadzone są przy wykorzystaniu powerpointa oraz przykładów polskich i zagranicznych przedsiębiorstw (case study) |
| Metody kształcenia  z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość | nie dotyczy |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Metody weryfikacji efektów uczenia się | | Nr efektu uczenia się/grupy efektów |
| Praca projektowa – analiza rynku i ryzyka dla dwóch wybranych przedsiębiorstw | | 03, 04, 05 |
| Egzamin w formie pisemnej (pytania obliczeniowe oraz otwarte) | | 01, 02 |
| Formy i warunki zaliczenia | Egzamin oraz praca projektowa | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| NAKŁAD PRACY STUDENTA | | | |
| Rodzaj działań/zajęć | Liczba godzin | | |
| Ogółem | W tym zajęcia powiązane  z praktycznym przygotowaniem zawodowym | W tym udział w zajęciach przeprowadzonych z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość |
| Udział w wykładach | 15 |  |  |
| Samodzielne studiowanie | 40 | 29 |  |
| Udział w ćwiczeniach audytoryjnych i laboratoryjnych, warsztatach, seminariach | 15 | 15 |  |
| Samodzielne przygotowywanie się do ćwiczeń | 35 | 30 |  |
| Przygotowanie projektu / eseju / itp. | 15 | 15 |  |
| Przygotowanie się do egzaminu / zaliczenia | 29 | 10 |  |
| Udział w konsultacjach | 1 | 1 |  |
| Inne |  |  |  |
| **ŁĄCZNY nakład pracy studenta w godz.** | 150 | 100 | 0 |
| **Liczba punktów ECTS za przedmiot** | **6** | | |
| Liczba punktów ECTS związana z zajęciami praktycznymi | 4 | | |
| Liczba punktów ECTS związana z kształceniem na odległość (kształcenie z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość) | 0 | | |
| Liczba punktów ECTS za zajęciach wymagające bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich | 1,8 | | |