

Studia podyplomowe oferowane przez Katedrę Rynków Finansowych UEK:

## ***Zarządzanie ryzykiem finansowym***

### **1. Adresaci studiów:**

Studia podyplomowe „*Zarządzanie ryzykiem finansowym*” są oferowane przez Katedrę Rynków Finansowych Uniwersytetu Ekonomicznego w Krakowie. Ich adresatami są w głównej mierze pracownicy instytucji finansowych, spółek inwestycyjnych, departamentów finansowych oraz działów zarządzania ryzykiem przedsiębiorstw, a także osoby prowadzące działalność gospodarczą oraz inwestorzy giełdowi. Program studiów bazuje na wymogach Global Association of Risk Professionals (GARP®), a tym samym umożliwia przygotowanie do egzaminów certyfikacyjnych i uzyskania tytułu Financial Risk Manager (FRM®), który jest powszechnie rozpoznawalny w branży finansowej i potwierdza wysokie kompetencje w zakresie zarządzania ryzykiem finansowym.

### **2. Cel studiów podyplomowych:**

Celem studiów jest przekazanie słuchaczom najbardziej aktualnej wiedzy oraz praktycznych umiejętności i narzędzi niezbędnych do efektywnego zarządzania ryzykiem finansowym, zarówno w instytucjach finansowych, jak i w przedsiębiorstwach. Poprzez nabycie praktycznych umiejętności samodzielnej analizy i konstrukcji modeli ryzyka finansowego, szacowania i prognozowania ryzyka w oparciu o konkretne dane empiryczne, absolwenci będą przygotowani do pracy w departamentach zarządzania ryzykiem. Ponadto, poprzez harmonizację programu studiów z wymogami Global Association of Risk Professionals (GARP®), absolwenci będą przygotowani do przystąpienia do egzaminu certyfikacyjnego Financial Risk Manager (FRM®) na poziomie I.

### **3. Program studiów:**

Lp.	Przedmiot	Liczba godzin	Punkty ECTS
<b>I.</b>	<b>Podstawy zarządzania ryzykiem</b>	<b>30</b>	<b>6</b>
1.	Wprowadzenie do zarządzania ryzykiem	9	2
2.	Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwie	9	2
3.	Standardy zarządzania ryzykiem	6	1
4.	Elementy teorii inwestowania	6	1
<b>II.</b>	<b>Rynki i instrumenty finansowe</b>	<b>30</b>	<b>8</b>
5.	Rynki finansowe	3	1
6.	Instrumenty finansowe o stałym dochodzie	9	2
7.	Instrumenty finansowe o zmiennym dochodzie	3	1

8.	Podstawowe instrumenty pochodne	6	1
9	Wycena opcji i hedging	9	3
<b>III.</b>	<b>Metody ilościowe w zarządzaniu ryzykiem</b>	<b>30</b>	<b>10</b>
10.	Elementy teorii prawdopodobieństwa	6	2
11.	Metody symulacyjne (Monte Carlo, bootstrap)	3	1
12.	Elementy statystyki opisowej i matematycznej	6	2
13.	Jednorównaniowe modele ekonometryczne	6	2
14.	Analiza szeregów czasowych i prognozowanie	9	3
<b>IV.</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem rynkowym</b>	<b>30</b>	<b>7</b>
15.	Podstawy zarządzania ryzykiem rynkowym	6	1
16.	Zaawansowane metody pomiaru ryzyka rynkowego	18	4
17.	Walidacja modeli ryzyka	6	2
<b>V.</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem kredytowym</b>	<b>30</b>	<b>7</b>
18.	Podstawy zarządzania ryzykiem kredytowym	6	1
19.	Scoring kredytowy	12	3
20.	Ryzyko portfela kredytowego	12	3
<b>VI.</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem operacyjnym oraz ryzykiem płynności</b>	<b>30</b>	<b>7</b>
21.	Podstawy zarządzania ryzykiem operacyjnym	6	1
22.	Pomiar ryzyka operacyjnego	12	3
23.	Ryzyko płynności	12	3
<b>SUMA:</b>		<b>180</b>	<b>45</b>

#### 4. Czas trwania studiów oraz liczba godzin:

Studia podyplomowe odbywać będą się w trybie niestacjonarnym w Krakowie (zajęcia weekendowe). Wymiar godzin studiów podyplomowych przypadających na słuchacza - 180 godzin. Czas trwania studiów podyplomowych - dwa semestry.

#### 5. Warunki oraz sposób zaliczenia studiów:

W ramach studiów podyplomowych realizowane będą 23 przedmioty, na których prezentowane będą treści teoretyczne oraz praktyczne, poparte doświadczeniem naukowym oraz zawodowym wykładowców. Na koniec studiów słuchacze przystępują do egzaminu końcowego.

Warunkiem uzyskania dyplomu ukończenia studiów podyplomowych jest obecność na zajęciach, a także uzyskanie pozytywnej oceny z egzaminu końcowego.

#### 6. Efekty uczenia się:

Kierunek na którym prowadzone są studia podyplomowe	<b>Zarządzanie ryzykiem finansowym</b>	
Dziedziny nauki i dyscypliny naukowe, z którymi związany jest kierunek studiów	Dziedzina: nauki społeczne Dyscyplina: ekonomia i finanse	
Profil studiów	Ogólnoakademicki	
Poziom Polskiej Ramy Kwalifikacji	7	
Poziom studiów	Studia podyplomowe	
Liczba semestrów	2	
Symbol efektu uczenia się dla kierunku	Opis efektów uczenia się	Odniesienie do charakterystyk efektów uczenia się
		Charakterystyki drugiego stopnia
<b>P_W (WIEDZA) Absolwent zna i rozumie:</b>		
<b>ZRF_W01</b>	pojęcia i kategorie ekonomiczne oraz teorie naukowe z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym oraz kierunki ich rozwoju	<b>P7S_WG</b>
<b>ZRF_W02</b>	zasady funkcjonowania rynków finansowych oraz reguły ekonomiczno-prawne dotyczące emisji instrumentów finansowych, metod i zasad ich wyceny, sposobów ich inwestowania, a także ryzyk z nimi związanych	<b>P7S_WG</b>
<b>ZRF_W03</b>	standardy zarządzania ryzykiem, w szczególności rynkowym, kredytowym, operacyjnym i płynności, a także normy etyczne i moralne, które powinny cechować osoby zawodowo zajmujące się zarządzaniem ryzykiem finansowym	<b>P7S_WG</b>
<b>ZRF_W04</b>	charakterystyki i zasady funkcjonowania instrumentów pochodnych oraz możliwości ich wykorzystania na potrzeby zabezpieczania przed ryzykiem finansowym	<b>P7S_WG</b>
<b>ZRF_W05</b>	metody i narzędzia obliczeniowe wykorzystywane w zarządzaniu ryzykiem finansowym, w tym do pomiaru ryzyka rynkowego, kredytowego, operacyjnego i płynności oraz modelowania zjawisk i procesów finansowych, a także do walidacji wykorzystywanych modeli	<b>P7S_WG</b>
<b>ZRF_W06</b>	ekonomiczne, prawne i społeczne uwarunkowania różnych rodzajów działań w obszarze pozyskiwania, przetwarzania i analizy danych finansowych i ekonomicznych, w tym informacji formalnych i nieformalnych, w ramach procesu zarządzania ryzykiem finansowym	<b>P7S_WG</b> <b>P7S_WK</b>
<b>P_U (UMIEJĘTNOŚCI) Absolwent potrafi:</b>		
<b>ZRF_U01</b>	samodzielnie pozyskiwać dane do analizowania procesów i zjawisk ekonomiczno-finansowych z wykorzystaniem metod badawczych, a także zachodzące między nimi relacje z wykorzystaniem wiedzy z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym	<b>P7S_UW</b>
<b>ZRF_U02</b>	formułować i rozwiązywać konkretne problemy z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym oraz podejmować rozstrzygnięcia w zakresie metod	<b>P7S_UW</b>

	i narzędzi zarządzania ryzykiem finansowym i ich stosowania w konkretnych jednostkach	
<b>ZRF_U03</b>	prawidłowo posługiwać się systemami normatywnymi, normami i regułami (prawnymi, zawodowymi, moralnymi) przy rozwiązywaniu wybranych problemów z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym	<b>P7S_UW</b>
<b>ZRF_U04</b>	komunikować się na tematy specjalistyczne z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym ze zróżnicowanymi kręgami odbiorców	<b>P7S_UW</b>
<b>ZRF_U05</b>	współdziałać i pracować w grupie, w tym przyjąć odpowiedzialność za pełnioną w niej funkcję	<b>P7S_UO</b>
<b>ZRF_U06</b>	uczyć się samodzielnie przez całe życie, planować własny rozwój i ukierunkowywać innych w zakresie zarządzania ryzykiem finansowym	<b>P7S_UU</b>
<b>P_K (KOMPETENCJE SPOŁECZNE) Absolwent jest gotów do:</b>		
<b>ZRF_K01</b>	samodzielnego pozyskiwania różnorodnych informacji i wykorzystywania ich w sposób krytyczny przy rozwiązywaniu problemów poznawczych i praktycznych z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym	<b>P7S_KK</b>
<b>ZRF_K02</b>	aktualizowania i doskonalenia w sposób ciągły i systematyczny wiedzy z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym w wymiarze specjalistycznym i interdyscyplinarnym, w tym zasięgania specjalistycznych opinii ekspertów	<b>P7S_KK</b> <b>P7S_KR</b>
<b>ZRF_K03</b>	wykorzystywania wiedzy i umiejętności w praktyce zawodowej przy realizacji zaawansowanych zadań zawodowych z zakresu zarządzania ryzykiem finansowym zgodnie z zasadami i normami etycznymi	<b>P7S_KR</b>
<b>ZRF_K04</b>	działania zgodnie z zasadami przedsiębiorczości, w tym wypełniania podjętych zobowiązań oraz proponowania nowych rozwiązań, a także inspirowania otoczenia i organizowania jego pracy	<b>P7S_KO</b>

**Objaśnienia oznaczeń w symbolach dotyczących kierunku:**

- ZRF – kierunek studiów podyplomowych: *Zarządzanie ryzykiem finansowym*
- W – kategoria wiedzy
- U – kategoria umiejętności
- K – kategoria kompetencji społecznych
- 01, 02, 03 i kolejne – numer efektu uczenia się

**Objaśnienia oznaczeń w odniesieniach do charakterystyk efektów uczenia się:**

- P – poziom Polskiej Ramy Kwalifikacji (PRK)
- P7S – charakterystyka drugiego stopnia poziomu 7 PRK

P7U\_W – charakterystyka uniwersalna (WIEDZA):

- P7S\_WG – charakterystyka drugiego stopnia (zakres i głębia)
- P7S\_WK – charakterystyka drugiego stopnia (kontekst)

P7U\_U – charakterystyka uniwersalna (UMIEJĘTNOŚCI):

- P7S\_UW – charakterystyka drugiego stopnia (wykorzystanie wiedzy)
- P7S\_UK – charakterystyka drugiego stopnia (komunikowanie się)
- P7S\_UO – charakterystyka drugiego stopnia (organizacja pracy)
- P7S\_UU – charakterystyka drugiego stopnia (uczenie się)

P7U\_K – charakterystyka uniwersalna (KOMPETENCJE SPOŁECZNE):

- P7S\_KK – charakterystyka drugiego stopnia (oceny/krytyczne podejście)
- P7S\_KO – charakterystyka drugiego stopnia (odpowiedzialność)
- P7S\_KR – charakterystyka drugiego stopnia (rola zawodowa)