

## PROGRAM STUDIÓW PODYPLOMOWYCH

### *Zarządzanie ryzykiem finansowym*

Katedra Rynków Finansowych UEK

#### 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 (tj. banki, fundusze inwestycyjne, towarzystwa ubezpieczeniowe), spółek inwestycyjnych, izb rozliczeniowych, 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>10</b>
1.	Wprowadzenie do zarządzania ryzykiem	9	3
2.	Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwie	9	3
3.	Standardy zarządzania ryzykiem	6	2
4.	Elementy teorii inwestowania	6	2
<b>II.</b>	<b>Rynki i instrumenty finansowe</b>	<b>30</b>	<b>10</b>
5.	Rynki finansowe	3	1
6.	Instrumenty finansowe o stałym dochodzie	9	3
7.	Instrumenty finansowe o zmiennym dochodzie	3	1
8.	Podstawowe instrumenty pochodne	6	2

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>10</b>
15.	Podstawy zarządzania ryzykiem rynkowym	6	2
16.	Zaawansowane metody pomiaru ryzyka rynkowego	18	6
17.	Walidacja modeli ryzyka	6	2
<b>V.</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem kredytowym</b>		<b>10</b>
18.	Podstawy zarządzania ryzykiem kredytowym	6	2
19.	Scoring kredytowy	12	4
20.	Ryzyko portfela kredytowego	12	4
<b>VI.</b>	<b>Zarządzanie ryzykiem operacyjnym oraz ryzykiem płynności</b>	<b>30</b>	<b>10</b>
21.	Podstawy zarządzania ryzykiem operacyjnym	6	2
22.	Pomiar ryzyka operacyjnego	12	4
23.	Ryzyko płynności	12	4
<b>SUMA:</b>		<b>180</b>	<b>60</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.

## 6. Efekty uczenia się

### EFEKTY UCZENIA SIĘ DLA STUDIÓW PODYPLOMOWYCH

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 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 i narzędzi zarządzania ryzykiem finansowym i ich stosowania w konkretnych jednostkach.	<b>P7S_UW</b>
<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 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)