



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Inżynieria finansowa w zarządzaniu przedsiębiorstwem, PG_00049682						
Kierunek studiów	Ekonomia						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2019 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2021/2022		
Poziom kształcenia	I stopnia - licencjackie	Grupa zajęć			Grupa zajęć fakultatywnych Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne	Sposób realizacji			na uczelni		
Rok studiów	3	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	6	Liczba punktów ECTS			4.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot	dr inż. Ewa Mazurek-Krasodomska					
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu	dr inż. Ewa Mazurek-Krasodomska					
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	0.0	30.0	0.0	0.0	0.0	30
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
Inżynieria finansowa w zarządzaniu przedsiębiorstwem - 2021/22 - Moodle ID: 20264 https://enauzanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=20264							
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów	Udział w konsultacjach		Praca własna studenta		RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	30	6.0		64.0		100
Cel przedmiotu	Zapoznanie studentów z konstrukcją i wykorzystaniem instrumentów pochodnych w celu ograniczenia ryzyka finansowego.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu			Sposób weryfikacji i oceny efektu	
	[K6_U05] potrafi diagnozować i prognozować procesy oraz zjawiska gospodarcze z wykorzystaniem metod i narzędzi właściwych dla nauk ekonomicznych		Student potrafi ocenić wartość instrumentów pochodnych: kontraktów forward, futures, opcji, swap i wykorzystać je w celu ograniczenia ryzyka finansowego.			[SU1] Ocena realizacji zadania	
	[K6_U15] umie doskonalić się poprzez systematyczne pozyskiwanie wiedzy i umiejętności		Student poszukuje wiedzy i pogłębia swoje umiejętności w stosowaniu instrumentów pochodnych.			[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi	
[K6_W07] ma wiedzę na temat podstawowych metod ilościowych i jakościowych wykorzystywanych w naukach ekonomicznych		Student zna metody wyceny instrumentów pochodnych.			[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej		
Treści przedmiotu	Istota i zastosowanie inżynierii finansowej. Instrumenty pochodne i ich klasyfikacja. Wycena kontraktów forward na aktywa. Walutowe kontrakty forward. Wycena kontraktów FRA; Wycena kontraktów swap; Wycena opcji: model dwumianowy i model Blacka-Scholesa. Współczynniki greckie. Strategie opcyjne i przykłady ich wykorzystania. Egzotyczne instrumenty pochodne i ich wykorzystanie. Strategie inwestowania w instrumenty pochodne.						
Wymagania wstępne i dodatkowe							
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)		Próg zaliczeniowy			Składowa oceny końcowej	
	Test z teorii		50.0%			10.0%	
	Dodatkowe aktywności		0.0%			10.0%	
	2 Kolokwia		60.0%			80.0%	

Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<p>1. Hull J., Kontrakty terminowe i opcyjne. Wprowadzenie, WIG Press, Warszawa 1997.</p> <p>2. Hull J. C., Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2011.</p> <p>3. Jajuga K., Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015.</p> <p>4. Zarządzanie ryzykiem, red. K. Jajuga, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2020.</p>
	Uzupełniająca lista lektur	<p>1. Bartkowiak M., Instrumenty pochodne. Wprowadzenie do inżynierii finansowej, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, Poznań 2014.</p> <p>2. Pruchnicka-Grabias I., Egzotyczne opcje finansowe. Systematyka, wycena, strategia, CeDeWu, Warszawa 2012.</p> <p>3. Weron A., Weron R., Inżynieria finansowa. Wycena instrumentów pochodnych. Symulacje komputerowe. Statystyka rynku, Wydawnictwo Naukowo-Techniczne, Warszawa 2019.</p>
	Adresy eZasobów	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Model dwumianowy. Model Blacka-Scholesa.	
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy	