



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	INSTRUMENTY POCHODNE W ZARZĄDZANIU FINANSAMI, PG_00037094						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2020 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu	2021/2022				
Poziom kształcenia	II stopnia	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	2	Język wykładowy	polski				
Semestr studiów	3	Liczba punktów ECTS	3.0				
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						
Instrumenty pochodne w zarządzaniu finansami (AGII_S) - 2021/22 - Moodle ID: 13599 https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=13599							
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	39.0	75		
Cel przedmiotu	Zapoznanie studentów z możliwością wykorzystania instrumentów pochodnych w celu ograniczania ryzyka finansowego oraz ich wyceną.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu			Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K7_W15] posiada pogłębioną wiedzę w zakresie procesów zachodzących w przedsiębiorstwie i ryzyk z nim związanych	Student posiada wiedzę dotyczącą ryzyka finansowego przedsiębiorstwa.			[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej		
	[K7_U14] umie doskonalić się poprzez systematyczne pozyskiwanie wiedzy i umiejętności	Student potrafi doskonalić się poprzez systematyczne pozyskiwanie wiedzy i umiejętności niezbędnych do wykorzystywania instrumentów pochodnych w celu ograniczania ryzyka finansowego.			[SU2] Ocena umiejętności analizy informacji		
[K7_U03] potrafi identyfikować i analizować przyczyny i przebieg konkretnych procesów i zjawisk gospodarczych i w oparciu o nie przedstawiać propozycje rozwiązań	Student potrafi dokonać oceny ryzyka finansowego przedsiębiorstwa i je ograniczać wykorzystując instrumenty pochodne.			[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi [SU2] Ocena umiejętności analizy informacji			
Treści przedmiotu	Istota instrumentów pochodnych i ich klasyfikacja. Kontrakty forward/futures na aktywa i ich wycena. Walutowe kontrakty forward. Kontrakty forward na stopę procentową. Zastosowanie kontraktów forward/futures. Wycena kontraktów swap na stopę procentową. Walutowe kontrakty swap. Podstawowe własności opcji. Wycena opcji w modelu dwumianowym. Formuła Blacka-Scholesa i jej konsekwencje. Strategie opcyjne. 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 zadania	0.0%	10.0%
	2 Kolokwia w czasie semestru	60.0%	80.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<p>1. Hull J., <i>Kontrakty terminowe i opcyjne</i>. Wprowadzenie, WIG Press, Warszawa 1997.</p> <p>2. Hull J. C., <i>Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2011.</p> <p>3. Jajuga K., <i>Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015.</p> <p>4. <i>Zarządzanie ryzykiem</i>, red. K. Jajuga, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2020.</p>	
	Uzupełniająca lista lektur	<p>1. Dębski W., <i>Rynek finansowy i jego mechanizmy</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2021.</p> <p>2. Golawska-Witkowska G., Rzeczycka A., <i>Instrumenty pochodne w ograniczaniu ryzyka bankowego</i>, Katedra Finansów, WZiE, PG, Gdańsk 2009.</p> <p>3. Kalinowski M., <i>Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej w przedsiębiorstwie</i>, CeDeWu, Warszawa 2009.</p> <p>4. Kalinowski M., <i>Zarządzanie ryzykiem walutowym w przedsiębiorstwie</i>, CeDeWu, Warszawa 2008.</p> <p>5. Pruchnicka-Grabias I., <i>Egzotyczne opcje finansowe</i>, CeDeWu, Warszawa 2016.</p>	
	Adresy eZasobów		
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Model dwumianowy. Model Blacka-Scholesa.		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		