



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	INŻYNIERIA FINANSOWA W ZARZĄDZANIU PRZEDSIĘBIORSTWEM, PG_00058466						
Kierunek studiów	Ekonomia						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2022 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2024/2025		
Poziom kształcenia	I stopnia - licencjackie	Grupa zajęć			Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów 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	5	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						
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	10.0		35.0		75
Cel przedmiotu	Wykorzystuje instrumenty pochodne w celu ograniczania ryzyka finansowego oraz przeprowadzają ich wycenę						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu			Sposób weryfikacji i oceny efektu	
	[K6_K02] podejmuje kompetentne i etyczne decyzje w celu tworzenia i utrzymania wartości ekonomicznych, społecznych i środowiskowych		wykorzystuje wyniki analiz do podejmowania decyzji w celu tworzenia i utrzymania wartości ekonomicznych, społecznych i środowiskowych			[SK5] Ocena umiejętności rozwiązywania problemów występujących w praktyce	
	[K6_U05] projektuje innowacyjne rozwiązania trudnych problemów uzyskując ekonomiczne i społecznie wartościowe wyniki		tworzy innowacyjne rozwiązania problemów wyceny instrumentów pochodnych			[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi	
Treści przedmiotu	Istota i zastosowanie inżynierii finansowej. Instrumenty pochodne i ich klasyfikacja. Wycena kontraktów forward na aktywa. Walutowe kontrakty forward/futures. Towarowe kontrakty forward/futures. Wycena kontraktów FRA. Wycena i konstrukcja walutowych kontraktów swap. Wycena i konstrukcja procentowych kontraktów swap. Wycena opcji z wykorzystaniem modelu dwumianowego. Model Blacka-Scholesa w wycenie opcji. Współczynniki greckie. Strategie opcyjne i przykłady ich wykorzystania. Egzotyczne instrumenty pochodne i ich wykorzystanie. Strategie inwestowania w instrumenty pochodne. Efektywność strategii hedgingowych.						
Wymagania wstępne i dodatkowe							

Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Dodatkowe aktywności	0.0%	10.0%
	2 Kolokwia	60.0%	80.0%
	Test z teorii	50.0%	10.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<p>Hull, J. (1997). Kontrakty terminowe i opcyjne. Wprowadzenie. Warszawa: WIG Press.</p> <p>Hull, J. C. (2011). Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN.</p> <p>Jajuga, K. (2015). Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN.</p> <p>Jajuga, K. (red.). (2020). Zarządzanie ryzykiem. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN.</p>	
	Uzupełniająca lista lektur	<p>Bartkowiak, M. (2014). Instrumenty pochodne. Wprowadzenie do inżynierii finansowej. Poznań: Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu.</p> <p>Pruchnicka-Grabias, I. (2012). Egzotyczne opcje finansowe. Systematyka, wycena, strategia. Warszawa: CeDeWu.</p> <p>Weron, A., Weron, R. (2019). Inżynieria finansowa. Wycena instrumentów pochodnych. Symulacje komputerowe. Statystyka rynku. Warszawa: Wydawnictwo Naukowo-Techniczne.</p>	
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczenie:	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Model dwumianowy. Model Blacka-Scholesa.		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		