



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	INŻYNIERIA FINANSOWA, PG_00053147						
Kierunek studiów	Zarządzanie (4 semestralne), Zarządzanie (3 semestralne)						
Data rozpoczęcia studiów	luty 2023 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2023/2024		
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	1	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	2	Liczba punktów ECTS			3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca							
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot						
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	30.0	0.0	0.0	0.0	45
	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	45		6.0		24.0	75
Cel przedmiotu	Poznanie metod konstrukcji i wyceny instrumentów pochodnych oraz zdobycie umiejętności efektywnego ich wykorzystania w ograniczaniu ryzyka finansowego w przedsiębiorstwie.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K7_U10] wykorzystuje odpowiednie metody i techniki wspomagające proces podejmowania decyzji do rozwiązania problemów występujących w jednostkach gospodarujących						
	[K7_W08] zna w sposób pogłębiony wybrane metody i techniki wspomagające procesy podejmowania decyzji gospodarczych						

Treści przedmiotu	<p>Wykłady:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Istota i zastosowanie inżynierii finansowej. Istota instrumentów pochodnych i ich klasyfikacja 2. Wykorzystania swapów do zabezpieczenia się przed ryzykiem. <ol style="list-style-type: none"> 1. Wycena kontraktów forward/futures. 2. Wycena swapów. 3. Wycena kontraktów opcyjnych. Model dwumianowy. Model Blacka-Scholesa-Mertona. 4. Wykorzystanie kontraktów terminowych do zabezpieczenia się przed ryzykiem walutowym. 5. Wykorzystanie kontraktów terminowych do zabezpieczenia się przed ryzykiem stopy procentowej. <ol style="list-style-type: none"> 1. Strategie opcyjne – przykłady wykorzystania. 2. Kryzysy związane z wykorzystaniem instrumentów pochodnych <p>Ćwiczenia:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Wycena kontraktów forward na aktywa: bez dywidendy, z dywidendą dyskretną, z dywidendą ciągłą. 2. Wycena kontraktów FRA. 3. Wycena kontraktów swap. 4. Konstruowanie kontraktów IRS i CCIRS. 5. Wycena opcji. Model dwumianowy dla opcji europejskich i amerykańskich. 6. Model Blacka-Scholesa-Mertona. 7. Opcje egzotyczne i ich wycena. 8. Strategie opcyjne - konstrukcja. 9. Delta hedging. 		
Wymagania wstępne i dodatkowe			
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	2 kolokwia pisemne	60.0%	100.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<ol style="list-style-type: none"> 1. Hull J., Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie, WIG Press, Warszawa 1998. 2. Weron A., Weron R., <i>Inżynieria finansowa. Wycena instrumentów pochodnych. Symulacje komputerowe. Statystyka rynku</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN-WNT, Warszawa 2019. 3. <i>Zarządzanie ryzykiem</i>, red. K. Jajuga, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2018. 	
	Uzupełniająca lista lektur	<ol style="list-style-type: none"> 1. Hull J. C., <i>Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2011. 2. Jajuga K., <i>Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015. 3. Orzeł J., <i>Zarządzanie ryzykiem operacyjnym za pomocą instrumentów pochodnych</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2012. 4. Tarczyński W., Zwolankowski M., <i>Inżynieria finansowa. Instrumentarium, strategię, zarządzanie ryzykiem</i>, Placet, Warszawa 1999. 	
	Adresy eZasobów		
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania			
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		