



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	INŻYNIERIA FINANSOWA, PG_00053152						
Kierunek studiów	Zarządzanie (4 semestralne), Zarządzanie (3 semestralne)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 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	niestacjonarne	Sposób realizacji			mieszane (blended-learning)		
Rok studiów	1	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	2	Liczba punktów ECTS			3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii						
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	8.0	16.0	0.0	0.0	0.0	24
W tym liczba godzin zajęć na odległość: 18.0							
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	24	6.0		45.0		75
Cel przedmiotu	Wykorzystuje zaawansowane instrumenty pochodne w celu ograniczania ryzyka finansowego oraz przeprowadza ich wycenę.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K7_W08] zna w sposób pogłębiony wybrane metody i techniki wspomagające procesy podejmowania decyzji gospodarczych	zna egzotyczne i tradycyjne instrumenty pochodne		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej			
	[K7_U10] wykorzystuje odpowiednie metody i techniki wspomagające proces podejmowania decyzji do rozwiązania problemów występujących w jednostkach gospodarujących	wykorzystuje instrumenty pochodne w celu ograniczania ryzyka finansowego przedsiębiorstwa		[SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi			
Treści przedmiotu	Istota i zastosowanie inżynierii finansowej. Wycena kontraktów forward/futures na aktywa. Wycena kontraktów FRA. Wycena i konstrukcja walutowych i procentowych kontraktów swap. Wycena opcji z wykorzystaniem modelu dwumianowego. Model Blacka-Scholesa w wycenie opcji: akcje bez dywidendy, akcje generujące dywidendę. Prawdopodobieństwo zmiany ceny. Przykłady opcji egzotycznych i ich wykorzystania. Strategie opcyjne - przykłady Strategie opcyjne - ryzyko i stopa zwrotu Współczynniki greckie Delta hedging 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%
	Test z teorii	50.0%	10.0%
	kolokwium	60.0%	80.0%
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	<p>Adresy na platformie eNauczenie:</p> <p>23/24 N Inżynieria finansowa - Moodle ID: 37726</p> <p>https://enauczenie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=37726</p>	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	Zaproponuj wykorzystanie instrumentu egzotycznego w celu ograniczenia ryzyka finansowego przedsiębiorstwa.		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		