



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	INŻYNIERIA FINANSOWA W ZARZĄDZANIU PRZEDSIĘBIORSTWEM, PG_00058466						
Kierunek studiów	Ekonomia						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2023 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2025/2026		
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						
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_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		
	[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		
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		
	Test z teorii		50.0%		10.0%		
	2 Kolokwia		60.0%		80.0%		
	Dodatkowe aktywności		0.0%		10.0%		

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