

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Fixed Income and Derivatives , PG_00124887						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2024/2025		
Poziom kształcenia	II stopnia	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	1	Język wykładowy			angielski		
Semestr studiów	1	Liczba punktów ECTS			8.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			egzamin		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania -> Katedra Finansów Przedsiębiorstw						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot	dr hab. Ewa Majerowska					
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu	dr hab. Ewa Majerowska					
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	30.0	30.0	0.0	0.0	0.0	60
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	60	41.0	110.0	211		
Cel przedmiotu	<p>Celem przedmiotu jest omówienie zagadnień związanych z kapitałem własnym/wartością firmy oraz walorami i instrumentami pochodnymi w ujęciu praktycznym: konstrukcja, wycena i zastosowanie na rynku finansowym. Przedmiot składa się z dwóch głównych bloków (poprzedzonych wykładem wprowadzającym):</p> <p>1) wycena przedsiębiorstwa</p> <p>2) przegląd papierów wartościowych o stałym dochodzie oraz instrumentów pochodnych, ich wycena i zastosowanie.</p> <p>Przedmiot skierowany jest do studentów posiadających podstawową wiedzę z zakresu finansów, zainteresowanych nowymi koncepcjami dotyczącymi instrumentów finansowych o stałym dochodzie. Ocena końcowa wynika z egzaminu pisemnego.</p>						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRMU2_K06] Kreatywność: - ma zdolność twórczego myślenia, potrafi wyjść poza utarte schematy, - potrafi myśleć i działać w sposób przedsiębiorczy, - potrafi elastycznie dostosować się do zmieniających się wymogów otoczenia.	Student ma zdolność twórczego myślenia, potrafi myśleć i działać w sposób przedsiębiorczy, potrafi wybrać odpowiedni instrument finansowy i ocenić jego przydatność.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_U07] Umie samodzielnie zaproponować rozwiązania konkretnych problemów z zakresu finansów i rachunkowości w oparciu o założone kryteria i doprowadzić do podjęcia rozstrzygnięć w tym zakresie.	Student umie zaproponować rozwiązanie konkretnych problemów związanych z wykorzystaniem instrumentów finansowych o stałym dochodzie oraz instrumentów pochodnych oraz doprowadzić do podjęcia odpowiednich decyzji.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_U06] Wykorzystuje zdobytą wiedzę w sposób kreatywny w różnych zakresach i formach do rozwiązywania problemów z zakresu finansów i rachunkowości pojawiających się w praktyce gospodarczej. Zna ograniczenia przydatności stosowanej wiedzy.	Student wykorzystuje zdobytą wiedzę w sposób kreatywny w zakresie doboru instrumentów finansowych o stałym dochodzie oraz instrumentów pochodnych. Zna ograniczenia związane z poznanymi narzędziami finansowymi.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_W07] Zna szczegółowo zasady oceny przedsięwzięć w zakresie finansów i rachunkowości (opłacalności projektów inwestycyjnych, oceny sytuacji finansowej organizacji, oceny ryzyka, zagrożenia upadłością). Potrafi zidentyfikować rodzaje ryzyka związanego z działalnością organizacji oraz prawidłowo określić ich konsekwencje i metody ograniczania przy umiejętnym wykorzystaniu wiedzy teoretycznej z zastosowaniem określonej metody badawczej.	Student zna zasady oceny przedsięwzięć w zakresie doboru instrumentów finansowych o stałym dochodzie oraz instrumentów pochodnych. Potrafi zidentyfikować rodzaje i poziom ryzyka związanego z ich wykorzystaniem.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_W09] Zna i rozumie w pogłębionym stopniu strukturę gramatyczną i słownictwo w zakresie swojej specjalności w języku obcym na poziomie B2+.	Studenta zna i rozumie w pogłębionym stopniu gramatykę i słownictwo w zakresie finansów związanych z instrumentami o stałym dochodzie oraz instrumentami pochodnymi.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja
	[FiRMU2_U09] Potrafi posługiwać się językiem obcym na poziomie B2+ Europejskiego Systemu Opisu Kształcenia Językowego oraz specjalistyczną terminologią. Posiada pogłębioną umiejętność przygotowywania prac pisemnych, wystąpień ustnych i prezentacji, w nowożytnym języku obcym, dotyczących zagadnień szczegółowych w zakresie swojej specjalności, z wykorzystaniem podstawowych ujęć teoretycznych, a także różnych źródeł informacji.	Student potrafi posługiwać się językiem obcym, posiada umiejętność wystąpień ustnych podczas zajęć oraz prac pisemnych w języku nowożytnym w zakresie zarządzania instrumentami finansowymi o stałym dochodzie.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny

Treści przedmiotu	1. Wycena obligacji. 2. Czas trwania i wypukłość. 3. Zarządzanie zobowiązaniami. Zabezpieczenie instrumentami o stałym dochodzie. 4. Teorie krzywej dochodowości. 5. Podstawy instrumentów pochodnych. Kontrakty terminowe, futures, opcje i swapy. 6. Wypłaty i strategie. Parytet put-call. 7. Wycena opcji. Drzewa dwumianowe. Wycena przy neutralnym ryzyku, model Blacka-Scholesa. 8. Obligacje korporacyjne i ryzyko kredytowe. swapy kredytowe.		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Elementy matematyki finansowej i wartości pieniądza w czasie.		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	projekt zaliczeniowy	51.0%	50.0%
	egzamin pisemny	51.0%	50.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	1. Fabozzi, F.J., Bond Markets, Analysis, and Strategies (9th Edition), Prentice Hall 2015 2. Fabozzi, F.J, The Handbook of fixed income securities, Prentice Hall 2005.	
	Uzupełniająca lista lektur	1. Sokołowska E., Alternative Investments in Wealth Management, Springer 2015	
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania			
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.