

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Pochodne instrumenty finansowe, PG_00157111						
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	niestacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	1		Język wykładowy		polski		
Semestr studiów	2		Liczba punktów ECTS		2.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Rektor -> Wydział Zarządzania -> Katedra Bankowości i Finansów						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr Sławomir Kujawa				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	0.0	10.0	0.0	0.0	0.0	10
	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	10		20.0		20.0	50
Cel przedmiotu	Prezentowanie studentom wiedzy z zakresu funkcjonowania rynku pochodnych instrumentów finansowych.Głównym celem przedmiotu jest przedstawienie zagadnień dotyczących zastosowania instrumentów pochodnych (arbitraż, hedging, spekulacja)						

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.	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.	[SK2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[FiRMU2_W02] Ma rozszerzoną i uporządkowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących, w szczególności o: systemie bankowym, ubezpieczeniowym, podatkowym, rynkach finansowych, organizacji systemu finansów publicznych oraz sektora prywatnego. Zna wzajemne relacje pomiędzy tymi strukturami i instytucjami społecznymi w skali krajowej i międzynarodowej.	Ma rozszerzoną i uporządkowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących, w szczególności o: systemie bankowym, ubezpieczeniowym, podatkowym, rynkach finansowych, organizacji systemu finansów publicznych oraz sektora prywatnego. Zna wzajemne relacje pomiędzy tymi strukturami i instytucjami społecznymi w skali krajowej i międzynarodowej.	[SW2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[FiRMU2_K03] Komunikacja: - potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie, - odważnie (ale z rozwagą) wyraża swoje zdanie, nie boi się zadawać pytań, - potrafi kulturalnie uczestniczyć w dyskusji, - umie wyrażać konstruktywną krytykę, - potrafi komunikować się na specjalistyczne tematy z zakresu finansów i rachunkowości ze zróżnicowanym kręgiem odbiorców.	Komunikacja: - potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie, - odważnie (ale z rozwagą) wyraża swoje zdanie, nie boi się zadawać pytań, - potrafi kulturalnie uczestniczyć w dyskusji, - umie wyrażać konstruktywną krytykę, - potrafi komunikować się na specjalistyczne tematy z zakresu finansów i rachunkowości ze zróżnicowanym kręgiem odbiorców.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja [SK2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[FiRMU2_U02] Potrafi wykorzystać zaawansowaną wiedzę teoretyczną do opisu przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk ekonomicznych. Potrafi formułować własne opinie krytyczne.	Potrafi wykorzystać zaawansowaną wiedzę teoretyczną do opisu przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk ekonomicznych. Potrafi formułować własne opinie krytyczne.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[FiRMU2_U01] Rozumie i potrafi prawidłowo interpretować złożone zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości oraz podstawowe w zakresie pozostałych nauk społecznych. Rozumie i umie w pogłębiony sposób wyjaśnić treść komunikatów instytucji gospodarczych, artykułów zamieszczanych w prasie i czasopismach z zakresu finansów. Prawidłowo stosuje pojęcia z zakresu nauk społecznych.	Rozumie i potrafi prawidłowo interpretować złożone zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości oraz podstawowe w zakresie pozostałych nauk społecznych. Rozumie i umie w pogłębiony sposób wyjaśnić treść komunikatów instytucji gospodarczych, artykułów zamieszczanych w prasie i czasopismach z zakresu finansów. Prawidłowo stosuje pojęcia z zakresu nauk społecznych.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja
	[FiRMU2_U04] Potrafi prognozować i modelować złożone procesy i zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi właściwych dla nauki o finansach.	Potrafi prognozować i modelować złożone procesy i zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi właściwych dla nauki o finansach.	[SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
Efekty uczenia się przedmiotu	[FiRMU2_K01] Samodoskonalenie: - rozumie potrzebę rozwoju i uczenia się przez całe życie, - inspiruje innych do nauki, - potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę i umiejętności, rozszerzone o wymiar interdyscyplinarny, - zna swoje silne i słabe strony, stawia sobie ambitne cele na miarę swoich możliwości, - umie przyjąć porażkę, przyznać się do błędu.	Samodoskonalenie: - rozumie potrzebę rozwoju i uczenia się przez całe życie, - inspiruje innych do nauki, - potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę i umiejętności, rozszerzone o wymiar interdyscyplinarny, - zna swoje silne i słabe strony, stawia sobie ambitne cele na miarę swoich możliwości, - umie przyjąć porażkę, przyznać się do błędu.	[SK2] prezentacja/projekt/referat/raport

	<table><tr><td>Efekt kierunkowy</td><td>Efekt z przedmiotu</td><td>Sposób weryfikacji i oceny efektu</td></tr><tr><td>[FiRMU2_W01] Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.</td><td>Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.</td><td>[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny</td></tr></table>	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu	[FiRMU2_W01] Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.	Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny
Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu					
[FiRMU2_W01] Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.	Ma rozszerzoną wiedzę o finansach i rachunkowości, ich miejscu w systemie nauk społecznych i relacjach do innych nauk społecznych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny					
Treści przedmiotu	1. Instrumenty pochodne (rynek kasowy a terminowy, rodzaje instrumentów pochodnych, instrumenty pochodne występujące na rynku giełdowym iOTC, rozliczanie transakcji, pozycje w kontraktach, wskaźniki greckie).2. Rynek kontraktów forward (dopasowanie do sytuacji rynkowej z perspektywy eksportera i importera) i futures (interpretacja nazw kontraktów futures, obliczanie depozytów zabezpieczających, obliczanie zysku i straty z inwestycji w kontrakty futures, zabezpieczanie pozycji kontraktami futures, stopy zwrotu ze spekulacji kontraktami futures na różne aktywa, wycena kontraktu na akcje, indeks, walutę, towar, różnice w wycenie kontraktów futures, rynek kontraktów CFD, kontrakty CFD na kryptowaluty).3. Rynek opcji (rozliczanie opcji call i put, znaczenie premii opcyjnej przy kupnie i sprzedaży, zakup i rozliczenie opcji call i put z mnożnikiem, wartość wewnętrzną i czasową opcji, inwestowanie z wykorzystaniem opcji, opcje dostępne na GPW w Warszawie).4. Rynek swapów (istota i rozliczenie transakcji swapowej, punkty swapowe).5. Strategie opcyjne (dopasowanie strategii opcyjnej do sytuacji rynkowej z perspektywy eksportera/importera, przegląd strategii opcyjnych w ofertach banków, konstrukcja strategii opcyjnych, tworzenie strategii opcyjnych).6. Analiza techniczna instrumentów pochodnych na rynku giełdowym i OTC.						
Wymagania wstępne i dodatkowe							
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa ocena końcowej				
	Wykonanie projektu w grupach (20% wagi)	51.0%	20.0%				
	Egzamin pisemny testowy, również z pytaniami otwartymi/ zadaniami (80% wagi).	51.0%	80.0%				
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	Hull, J., tłum. Dąbrowski, P., Sobkowiak, J., Kontrakty terminowe i opcje: wprowadzenie, WIG-Press, Warszawa 1997,Broszkiewicz M., Pauka M., Podstawy rynku finansowego, przykłady i zadania, Wyd. Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu, Wrocław 2019,					
	Uzupełniająca lista lektur	Zalewski G., Kontrakty terminowe w praktyce, WIG PRESS, Warszawa 2008.Tymuła I., Swapy finansowe, Biblioteka Menadżera i Bankowca, Warszawa 2000Wiśniewska, E., Giełdowe instrumenty pochodne, CeDeWu.PL Wydawnictwa Fachowe, Warszawa 2008.Jajuga K., Zarządzanie ryzykiem, Wydawnictwo PWN, Warszawa 2019.Kujawa S., Inwestycje klasyczne i alternatywne w kontekście uwarunkowań behawioralnych, Wydawnictwo UG, Gdańsk 2020					
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:					
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	1. Instrumenty pochodne 2. Rynek kontraktów forward i futures3. Rynek opcji4. Rynek swapów (istota i rozliczenie transakcji swapowej, punkty swapowe).5. Strategie opcyjne 6. Analiza techniczna instrumentów pochodnych na rynku giełdowym i OTC						
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy						

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.