



Sylabus przedmiotu – część A
Inżynieria finansowa

37S2-INZFIN

ECTS: 3.5

CYKL: 2021Z

TREŚCI MERYTORYCZNE

WYKŁAD

Wprowadzenie do inżynierii finansowej. Podstawowe pojęcia statystyczne z obszaru rynku finansowego. Zarządzanie portfelem-modele wskaźnikowe. Model wyceny dóbr kapitałowych CAPM. Teoria arbitrażu cenowego APT. Optymalizacja portfela Markowitza. Model Blacka-Scholesa. Wycena instrumentów złożonych. Strategie opcyjne

ĆWICZENIA

Wartość pieniądza w czasie. Wycena weksli, akcji, obligacji, kontraktów terminowych, opcji.

CEL KSZTAŁCENIA

Zapoznanie studentów z zasadami wyceny wybranych instrumentów finansowych oraz z zasadami budowy portfeli inwestycyjnych

OPIS EFEKTÓW UCZENIA SIĘ PRZEDMIOTU W ODNIESIENIU DO OPISU

**CHARAKTERYSTYK DRUGIEGO STOPNIA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ DLA KWALIFIKACJI
NA POZIOMACH 6-8 POLSKIEJ RAMY KWALIFIKACJI W ODNIESIENIU DO DYSYPLIN
NAUKOWYCH I EFEKTÓW KIERUNKOWYCH**

Symbole efektów dyscyplinowych:

S/NZJA_P7S_UW++, S/NZJA_P7S_WG++, S/EFA_P7S_KR+,
S/EFA_P7S_UW++, S/EFA_P7S_WG++

Symbole efektów kierunkowych:

KA7_UW2+, KA7_WG5+, KA7_UW1 +, KA7_KR1 +,
KA7_WG3 +

EFEKTY UCZENIA SIĘ:

Wiedza:

W1 –Zna i rozumie wybrane instrumenty finansowe

W2 –Zna i rozumie zasady wyceny instrumentów finansowych

Umiejętności:

U1 –Potrafi wycenić podstawowe instrumenty finansowe

U2 –Potrafi wycenić wybrane instrumenty pochodne

Kompetencje społeczne:

K1 –Gotów do określenia zalet i wad inwestycji w instrumenty finansowe, oceny ryzyka inwestycji w instrumenty finansowe

FORMY I METODY DYDAKTYCZNE:

Wykład(W1, W2, U1, U2):Wykład informacyjny

Ćwiczenia(U1, U2, K1):Ćwiczenia praktyczne - Analiza wybranych zagadnień z wykorzystaniem zadań i danych liczbowych z bazy Refinitiv Eikon.

FORMA I WARUNKI WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ:

Akty prawne określające efekty uczenia się:

80/2021

Dyscypliny: ekonomia i finanse, nauki o zarządzaniu i jakości

Status przedmiotu: Obligatoryjny

Grupa przedmiotów: C - przedmioty specjalnościowe/związane z zakresem kształcenia

Kod: ISCED 0311

Kierunek studiów: Ekonomia

Zakres kształcenia: Ekonomia menedżerska i doradztwo finansowe

Profil kształcenia: Ogólnoakademicki

Forma studiów: Stacjonarne

Poziom studiów: Drugiego stopnia

Rok/semestr: 2/3

Rodzaj zajęć: Wykład, Ćwiczenia

Liczba godzin w semestrze: Wykład:

15.00, Ćwiczenia: 30.00

Język wykładowy: polski

Przedmioty wprowadzające:

rachunkowość, mikroekonomia, finanse, rynek finansowy

Wymagania wstępne: umiejętność rozpoznawania podstawowych kategorii z zakresu rynku finansowego, mikroekonomii i finansów

Nazwa jednostki org. realizującej

przedmiot: Instytut Ekonomii i Finansów

Osoba odpowiedzialna za realizację

przedmiotu: dr Marek Szturo

e-mail: marsz@uwm.edu.pl

Uwagi dodatkowe:

Ćwiczenia: Kolokwium pisemne - Student otrzymuje zestaw 3 zadań do samodzielnego rozwiązania, dotyczących poszczególnych tematów realizowanych podczas zajęć. Rozwiązanie przez studenta prawidłowo pełnego zadania oznacza otrzymanie oceny dostatecznej. Dwa zadania w pełni prawidłowo rozwiązane uprawniają do oceny dobrej, natomiast trzy zadania prawidłowo rozwiązane to ocena bardzo dobra. Częściowe rozwiązanie zadania uprawnia do ocen połówkowych: dostateczny plus (rozwiązane jedno zadanie i połowa drugiego); ocena dobry plus (rozwiązanie dwóch zadań i połowy trzeciego). (U1, U2, K1);

Wykład: Egzamin pisemny - Student wypełnia test egzaminacyjny wielokrotnego wyboru. (W1, W2, U1, U2);

LITERATURA PODSTAWOWA:

1. Weron A., Weron R., tytuł: Inżynieria finansowa, wyd. WNT, rok 2005
2. Jajuga K., Jajuga T., tytuł: Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, wyd. PWN, rok 2011
3. Reilly F.K. , Brown K. C., tytuł: Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, wyd. PWE, rok 2001
4. Hull J., tytuł: Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie, wyd. WIG-Press, rok 1999

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

1. M. Szturo i in., tytuł: Impact of Commodity Market Risk on Listed Companies, wyd. Springer Proceedings in Business and Economics, rok 2020
2. M. Szturo i in., tytuł: New financial markets and their impact on raw material prices, wyd. Annales Universitatis Mariae Curie-Skłodowska, rok 2019

Szczegółowy opis przyznanej punktacji ECTS – część B

37S2-INZFIN

ECTS: 3.5

CYKL: 2021Z

Inżynieria finansowa

Na przyznaną liczbę punktów ECTS składają się:

1. Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim:

- udział w: Wykład	15.0 h
- udział w: Ćwiczenia	30.0 h
- konsultacje	5.0 h
OGÓŁEM: 50.0h	

2. Samodzielna praca studenta:

przygotowanie do egzaminu pisemnego z przedmiotu	35.00 h
przygotowanie do kolokwium	25.00 h
przygotowanie do ćwiczeń	25.00 h

OGÓŁEM: 85.0h

godziny kontaktowe + samodzielna praca studenta OGÓŁEM: 135.0h

1 punkt ECTS = 25-30 h pracy przeciętnego studenta,
liczba punktów ECTS= 135.0 h : 27.0h/ECTS = 5.00 ECTS

Średnio: 3.5 ECTS

- w tym liczba punktów ECTS za godziny kontaktowe z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego	1.85 punktów ECTS
- w tym liczba punktów ECTS za godziny realizowane w formie samodzielnej pracy studenta	1.65 punktów ECTS