

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Fixed Income and Derivatives, PG_00177638						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2025 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2025/2026		
Poziom kształcenia	II stopnia		Grupa zajęć		Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów Grupa zajęć fakultatywnych 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	2		Liczba punktów ECTS		6.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Rektor -> Wydział Zarządzania -> Katedra Finansów Przedsiębiorstw						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr hab. Ewa Majerowska				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	30.0	15.0	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		4.0		86.0	150
Cel przedmiotu	Celem przedmiotu jest omówienie zagadnień kapitału własnego/wartości firmy oraz papierów wartościowych o stałym dochodzie i instrumentów pochodnych z perspektywy praktycznej: konstrukcji, wyceny i zastosowania w obszarze rynków finansowych.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRMU2_U04] Student potrafi - z perspektywy finansów i rachunkowości - poprawnie wybrać oraz właściwie wykorzystywać, przystosowywać lub opracowywać nowe metody i narzędzia z zakresu nauk o zarządzaniu i jakości oraz ekonomii i finansów - na potrzeby analizy i prognozy procesów gospodarczych oraz oceny zjawisk gospodarczych.	Student potrafi wybrać odpowiednie instrumenty finansowe do inwestycji, wykorzystać zaawansowane metody i narzędzia do ich analizy. Potrafi również ocenić przydatność instrumentów finansowych w kontekście oczekiwanych przyszłych efektów.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/ raport [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_W05] Student w pogłębionym stopniu zna i rozumie zaawansowane (w tym innowacyjne) metody, narzędzia oraz techniki pozyskiwania, wykorzystania i analizy danych niezbędnych do oceny sytuacji finansowej różnych podmiotów w obszarze nauk o zarządzaniu i jakości oraz ekonomii i finansów.	Student ma wiedzę na temat zaawansowanych metod wyceny instrumentów finansowych. Wie, jak pozyskiwać dane finansowe z różnych baz danych, jak je analizować i oceniać w kontekście zwrotu i ryzyka.	[SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport
	[FiRMU2_W02] Student w pogłębionym stopniu zna i rozumie specyfikę, złożoność oraz funkcjonowanie krajowego i międzynarodowego rynku finansowego oraz instrumentów i instytucji finansowych.	Student ma szeroką wiedzę na temat różnorodnych instrumentów finansowych funkcjonujących na różnych rynkach, w tym wiedzę na temat instrumentów o stałym dochodzie i instrumentów pochodnych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport
Treści przedmiotu	1. Wycena obligacji. Dochody i bootstrapping 2. Czas trwania i wypukłość. 3. Zarządzanie zobowiązaniami. Zabezpieczanie 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 dla neutralnego podejścia do ryzyka i model Blacka i Scholesa. 8. Obligacje korporacyjne i ryzyko kredytowe. Swapy kredytowe.		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Matematyka finansowa i wartość pieniądza w czasie.		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Test pisemny	51.0%	50.0%
	Projekt	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. Hull J.C., Options, Future and Other Derivatives, Prentice Hall 2017	
	Uzupełniająca lista lektur	1. Fabozzi, F.J, The Handbook of Fixed Income Securities, Prentice Hall, 2005 2. Sokołowska E., Alternative Investments in Wealth Management, Springer 2015	
	Adresy eZasobów		
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	1. Wyjaśnij ideę możliwości arbitrażu. 2. Opisz rodzaje miar rentowności.		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.