

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Fixed Income and Derivatives, PG_00177638						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2026 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2026/2027		
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_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
	[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_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
Treści przedmiotu	<ol style="list-style-type: none"> 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	<ol style="list-style-type: none"> 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	<ol style="list-style-type: none"> 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	<ol style="list-style-type: none"> 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.