

Nazwa przedmiotu:	Rynki i instrumenty finansowe			
Forma: Wykład	Godzin: 15 Semestr: 5 Rok: III	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 2	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Rachunkowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: licencjackie		
Specjalność: ZF				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
prof. dr hab.	KiFiZR	zi_ifizr@ue.wroc.pl	3680338	308-Z

1. Wymagania wstępne

Rynek kapitałowy i pieniężny, podstawy nauki o finansach, analiza i zarządzanie portfelem

2. Program przedmiotu

Przegląd instrumentów rynku finansowego. Ogólne podejście w wycenie instrumentów finansowych. Analiza instrumentów rynku pieniężnego. Analiza obligacji: wycena, YTM i jej własności, krzywa stopy dochodu, ryzyko w inwestowaniu w obligacje. Strategie inwestowania w obligacje. Analiza i wycena akcji. Analiza opcji: wycena, współczynniki wrażliwości. Analiza kontraktów terminowych: wycena, współczynnik zabezpieczenia. Analiza i wycena swapów. Inne instrumenty pochodne. Strategie spekulacyjne, hedgingowe i arbitrażowe na rynku instrumentów pochodnych. Analiza zaawansowanych instrumentów pochodnych.

3. Metodyka zajęć

prezentacja teorii w zakresie analizy instrumentów finansowych

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: całością narzędzi analizy instrumentów finansowych.
Umiejętności: wycena i analiza konkretnych instrumentów finansowych.

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe
2. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P.: Inwestycje finansowe. Wyd. AE, Wrocław 1998.
3. Hull J.: Kontrakty terminowe i opcje – wprowadzenie. Wyd. WIG PRESS, Warszawa 1997

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

1. Fabozzi F.: Rynek obligacji, analiza i strategie. Wyd. WIG PRESS Warszawa 2000.
2. Taylor F.: Rynki i opcje walutowe. Dom Wydawniczy ABC, Kraków 2000.