

Nazwa przedmiotu:	1.IINSTRUMENTY FINANSOWE			
Forma: Ćwiczenia	Godzin: 45 Semestr: 10 Rok: V	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS	
Wydział: ZIF	Kierunek: Informatyka i Ekonometria	Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie		
Specjalność: Ekonometria menedżerska				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
mgr	Katedra Bankowości	zi_b@ue.wroc.pl	713680355	103 M

### 1. Wymagania wstępne

Rynek kapitałowy i pieniężny

### 2. Program przedmiotu

Analiza instrumentów rynku pieniężnego. Analiza obligacji: rodzaje, 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. Instrumenty rynku walutowego.

### 3. Metodyka zajęć

rozwiązywanie zadań teoretycznych i analiza przypadków z praktyki rynku, wymagana jest aktywność na ćwiczeniach,

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: zaznajomienie studentów z nowoczesną teorią finansów w zakresie analizy i wyceny instrumentów finansowych oraz strategii inwestycyjnych

umiejętności: konstrukcja strategii inwestycyjnych

### Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa., PWN, Warszawa 2006
2. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P.: Inwestycje finansowe. Wyd. AE, Wrocław 1998.

### 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. .