

Nazwa przedmiotu: INSTRUMENTY FINANSOWE				
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: 10 Rok: V	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 10	
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
dr	Katarzyna Kuziak	zi_ifzr@ue.wroc.pl	3680373	709Z

### 1. Wymagania wstępne

Rynek kapitałowy i pieniężny

### 2. Program przedmiotu

Analiza instrumentów rynku pieniężnego. Ogólne podejście w wycenie instrumentów finansowych. 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

prezentacja teorii w zakresie analizy instrumentów finansowych, rozwiązywanie zadań teoretycznych i analiza przypadków z praktyki rynku,

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: całokształt 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, inżynieria finansowa. PWN, Warszawa 2006.
2. Hull J.: Kontrakty terminowe i opcje – wprowadzenie. Wyd. WIG PRESS, Warszawa 1997.
3. Fabozzi F.: Rynek obligacji, analiza i strategie. Wyd. WIG PRESS Warszawa 2000.
4. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P.: Inwestycje finansowe. Wyd. AE, Wrocław 1998.

### Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)