

| | | | | |
|--------------------------------------|-------------------------------------|--|---------|---------|
| Nazwa przedmiotu: | INSTRUMENTY FINANSOWE | | | |
| Forma: Wykład | Godzin: 30 Semestr: 5 Rok: III | Forma zaliczenie: zal. na ocenę | ECTS | |
| Wydział: ZIF | Kierunek: Informatyka i Ekonometria | Tryb: stacjonarny Rodzaj: licencjackie | | |
| Specjalność: Ekonometria menedżerska | | | | |
| Tytuł, stopień | Imię i nazwisko lub nazwa katedry | e-mail | telefon | Pok/bud |
| prof. dr hab. | KiFiZR | zi_ifzr@ue.wroc.pl | 3680338 | 307Z |

1. Wymagania wstępne

Matematyka, podstawy makro- i mikroekonomii

2. Program przedmiotu

obligacje – rodzaje i wycena, stopa YTM i jej własności, krzywa dochodowości, ryzyko w inwestowaniu w obligacje, duration, convexity, strategie inwestowania w obligacje, wycena akcji i praw poboru, analiza polskich akcji i próba ich wyceny metodą zdyskontowanych przepływów pieniężnych, wartość wewnętrzna i terminowa opcji oraz czynniki wpływające na cenę opcji i współczynniki wrażliwości, modele wyceny opcji – model dwumianowy, modele wyceny opcji – model Blacka-Scholesa i jego uogólnienia, strategie inwestowania w opcje hedging i arbitraż, swapy

3. Metodyka zajęć

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

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: całokształt narzędzi analizy instrumentów finansowych.

Umiejętności: wycena i analiza konkretnych instrumentów finansowych, budowanie 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. 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.

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)