

Nazwa przedmiotu:	INSTRUMENTY FINANSOWE			
Forma: Ćwiczenia	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	80338	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, strategię 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, strategię 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 strategię. Wyd. WIG PRESS Warszawa 2000.

### Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)