

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	HEDGING FINANSOWY		
FiR/O/I/S/B2-47b			FINANCIAL HEDGING		
Język wykładowy		Polski			
Rok akademicki		2023/2024			
Kierunek		Finanse i rachunkowość			
w zakresie		-			
Poziom studiów		studia pierwszego stopnia			
Profil studiów		ogólnoakademicki			
Forma studiów		studia stacjonarne			
Semestr / semestry		6 letni			
Przynależność do grupy zajęć		Grupa zajęć kierunkowych obieralnych			
Status przedmiotu		Obieralny			
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS	
		Wykład	[h]	2 ECTS	
		Ćwiczenia	[h]		
		Konwersatorium	30 [h]		
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse			1,5 ECTS
	z uprawnieniami	-----			ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse			2 ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni z możliwością realizowania zajęć z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość			
Wymagania wstępne		Wszyscy studenci kierunku Finanse i Rachunkowość, którzy wybiorą ten przedmiot			
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych			
Koordynator		dr Grażyna A. Olszewska			
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl			
Adres e-mail, telefon koordynatora		g.olszewska@uthrad.pl (48) 361-7482			

EFEKTY UCZENIA SIĘ, TREŚCI PROGRAMOWE, REALIZACJA ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH, WERYFIKACJA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ

Cel kształcenia:	<i>Celem wykładu jest przekazanie studentom wiedzy dotyczącej istoty strategii zabezpieczających przed ryzykiem z wykorzystaniem instrumentów finansowych a w szczególności instrumentów pochodnych</i>
Treści programowe:	<p>Podstawowe strategie inwestycyjne w procesie zarządzania ryzykiem (4h, BN, W1,W2, U1, U2, K1, K2) Hedging (zabezpieczenie przed ryzykiem) Spekulacja (kupowanie ryzyka) Arbitraż (wyrównywanie cen)</p> <p>Wybrane strategie inwestycyjne na rynku opcji Wybrane strategie inwestycyjne na rynku futures Hedging finansowy a hedging naturalny</p> <p>Instrumenty pochodne jako narzędzie zarządzania ryzykiem (4h, BN, W1,W2,) Pojęcie rynku instrumentów pochodnych (derywatów) Funkcje instrumentów pochodnych Struktura rynku instrumentów pochodnych Organizacja rynku instrumentów pochodnych</p> <p>Charakterystyka opcji (6h, W1,W2,) Podstawowe rodzaje opcji Podstawowe rodzaje transakcji na rynku opcji Pozycje w kontraktach opcyjnych Instrumenty bazowe</p> <p>Charakterystyka kontraktów forward i futures(6h, W1,W2,) Pojęcie i cechy kontraktów forward i futures Pozycje w kontraktach Instrumenty bazowe Różnice między kontraktami forward i futures</p> <p>Charakterystyka kontraktów swapów(6h, W1,W2, Swap walutowy (currency swap) Swap procentowy (interestrate swap) Pośrednicy na rynku swapów</p> <p>Rodzaje hadging finansowego (4h, BN, W1,W2, U1, U2, K1, K2) Skłonność do ryzyka, wycena ryzyka</p>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	wykład konwersatoryjny metoda przypadków dyskusja
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p><i>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</i></p> <p><i>Ocena z pracy pisemnej 90%, aktywność na zajęciach 10%</i></p>

Efekty uczenia się dla przedmiotu w odniesieniu do efektów kierunkowych i formy zajęć				Metody weryfikacji efektów uczenia się	
Numer efektu uczenia się	Opis efektów uczenia się dla przedmiotu (PEU) Student, który zaliczył przedmiot (W) zna i rozumie/ (U) potrafi /(K) jest gotów do:	Kierunkowy efekt uczenia się (KEU)	Forma zajęć	Forma weryfikacji (zaliczeń)	Metody sprawdzania i oceny
W1	Posiada rozszerzoną wiedzę o konstrukcji i wykorzystaniu instrumentów pochodnych w strategiach zarządzania ryzykiem przez podmioty gospodarujące	K_W06 K_W09	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
W2	Posiada pogłębioną wiedzę na temat organizacji i funkcjonowania rynku instrumentów pochodnych oraz metod	K_W05 K_W11	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	Praca pisemna

	<i>i narzędzi właściwych dla jego poznania</i>				
U1	<i>Potrafi zebrać i wyselekcjonować dane niezbędne do oceny i analizy zjawisk zachodzących na rynkach finansowych</i>	<i>K_U05</i>	<i>konwersatorium</i>	<i>zaliczenia na ocenę</i>	<i>Praca pisemna</i>
K1	<i>Ma świadomość dynamicznych zmian zachodzących na rynkach finansowych i konieczności kontynuowania procesu uczenia się i pogłębiania wiedzy w celu rozwiązywania problemów również w interesie publicznym</i>	<i>K_K05 K_K06</i>	<i>konwersatorium</i>	<i>zaliczenia na ocenę</i>	<i>Dyskusja</i>

Literatura i pomoce naukowe	
<ol style="list-style-type: none"> 1. Dębski W., <i>Rynek finansowy i jego mechanizmy</i>, PWN, Warszawa 2005. 2. Olszewska G.A.: <i>Rynki finansowe XXI wieku</i>, [w:] <i>Od kryzysu do ożywienia – dylematy współczesnej polityki finansowej</i>, Bednarczyk J.L., Przybylska – Kapuścińska W., (red.), CeDeWu, Warszawa 2011. 3. Olszewska G.A.: <i>Stopy oszczędności wewnętrznych a wzrost gospodarczy w krajach Europy Środkowej na przykładzie Polski, Czech, Słowacji oraz Węgier</i>, [w:] <i>Wybrane problemy funkcjonowania Unii Gospodarczej i walutowej</i>, Bilski J., Feder-Sempach E., (red.), Wydawnictwo Uniwersytetu Łódzkiego, Folia Oeconomica 238, Łódź 2010. 4. Tarczyński W., <i>Instrumenty pochodne na rynku kapitałowym</i>, PWE, Warszawa 2003. <p>Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podaje prowadzący</p>	

Nakład pracy studenta potrzebny do osiągnięcia zakładanych efektów uczenia się – bilans punktów ECTS			
Udział w zajęciach, aktywność	Obciążenie studenta [h]		
	Inne godz. kontaktowe (IGK)	Zajęcia bez nauczyciela-praca własna studenta (ZBN)	Zajęcia dydaktyczne
Udział w wykładach/konwersatoriach	X	X	30 [h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X[h]
Udział w konsultacjach	5 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwiczeń/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	15 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	15 [h]/ 0,6 ECTS	30 [h]/ 1,2 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	50 [h] / 2 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
<p>W przypadku studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych, określone powyżej (w karcie) metody i formy weryfikacji efektów uczenia się dostosowuje się odpowiednio do indywidualnych potrzeb tych studentów.</p> <p>Szczegółowe zasady i formy wsparcia studentów ze szczególnymi potrzebami: w tym z niepełnosprawnością, przewlekle chorych podczas zajęć, zaliczeń i egzaminów określono w: Regulaminie Studiów, Zasadach Studiowania, Procedurze dotyczącej zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych.</p>