

## Sylabus przedmiotu

Przedmiot:	<b>Behawioralna inżynieria finansowa</b>
Kierunek:	Finanse i rachunkowość, II stopień [4 sem], stacjonarny, ogólnoakademicki, rozpoczęty w: 2013
Specjalność:	doradca finansowy
Tytuł lub szczegółowa nazwa przedmiotu:	Behawioralna inżynieria finansowa
Rok/Semestr:	II/4
Liczba godzin:	15,0
Nauczyciel:	<b>Kicia Mariusz, dr</b>
Forma zajęć:	wykład
Rodzaj zaliczenia:	egzamin
Punkty ECTS:	4,0
Godzinowe ekwiwalenty punktów ECTS (łącznie liczba godzin w semestrze):	5,0 Godziny kontaktowe z prowadzącym zajęcia realizowane w formie konsultacji 15,0 Godziny kontaktowe z prowadzącym zajęcia realizowane w formie zajęć dydaktycznych 30,0 Przygotowanie się studenta do zajęć dydaktycznych 30,0 Przygotowanie się studenta do zaliczeń i/lub egzaminów 40,0 Studiowanie przez studenta literatury przedmiotu
Poziom trudności:	zaawansowany
Wstępne wymagania:	Student powinien posiadać przynajmniej podstawową wiedzę na temat mechanizmów i instrumentów rynku finansowego oraz matematyki finansowej. Znajomość przynajmniej podstaw statystyki będzie dodatkowym atutem.
Metody dydaktyczne:	<ul style="list-style-type: none"> <li>• warsztaty grupowe</li> <li>• wykład informacyjny</li> <li>• wykład konwersatoryjny</li> </ul>
Zakres tematów:	<p><b>Inżynieria finansowa</b> (financial engineering) obejmuje projektowanie, rozwój i zastosowanie innowacji w zakresie instrumentów i procesów finansowych oraz formułowanie twórczych rozwiązań problemów finansowych. Inżynieria finansowa jest dziedziną nauki bazującą na wiadomościach z zakresu matematyki finansowej. Jej celem jest analiza instrumentów pochodnych rynku finansowego, metody wyceny tych instrumentów oraz sposoby ich wykorzystywania w zarządzaniu ryzykiem finansowym. Inżynieria finansowa rozumiana może być również jako sposób finansowania przedsięwzięć gospodarczych, w których wykorzystywane są różne kombinacje instrumentów, form i instytucji finansowych (montaż finansowy).</p> <p><b>Program zajęć:</b></p> <p>1.Percepcja dochodowości i ryzyka – elementy finansów behawioralnych 2.Ryzyko i zarządzanie ryzykiem 3.Ograniczanie ryzyka za pomocą instrumentów pochodnych 4.Problem opcji walutowych w Polsce – case study 5.Wycena i kombinacje instrumentów pochodnych 6.Projektowanie syntetycznych instrumentów finansowych</p>
Forma oceniania:	<ul style="list-style-type: none"> <li>• egzamin pisemny</li> </ul>
Warunki zaliczenia:	Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest uzyskanie pozytywnego wyniku w egzaminie końcowym. Warunkiem przystąpienia do egzaminu jest wcześniejsze uzyskanie zaliczenia ćwiczeń potwierdzone wpisem do indeksu i karty ocen.
Literatura:	1. Bernstein P. (1997), Przeciw bogom. Niezwykłe dzieje ryzyka, WigPress 2. Best P. (2004), Wartość narażona na ryzyko, OE Kraków 3. Hull J. (1998), Kontrakty terminowe i opcje, PWN Warszawa 4. Jajuga K., Jajuga T. (2007), Inwestycje. Instrumenty finansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa, PWN Warszawa 5. Jajuga K. (2007), Zarządzanie ryzykiem, PWN Warszawa 6. Weron A., Weron R. (1998), Inżynieria finansowa. Wycena instrumentów pochodnych. Symulacje komputerowe. Statystyka rynku, WNT Warszawa 7. Zaleśkiewicz T. (2004), Psychologia inwestora giełdowego, PWE Gdańsk