



Przedmiot: Produkty strukturyzowane				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 8	Rok: 4	Wymiar godzin: 15	Punkty ECTS: 1
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: do wyboru		Język nauczania: polski
Kierunek: Finanse i Rachunkowość			Tryb: stacjonarne	Rodzaj: magisterskie
Specjalność: Globalne rynki finansowe				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: prof. dr hab.		Imię i nazwisko wykładowcy: Jacek Karwowski		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Finanse międzynarodowe, Rynki finansowe

Program przedmiotu:

1. Definicja oraz konstrukcja produktów strukturyzowanych.
2. Rodzaje produktów strukturyzowanych.
3. Rodzaje profilów wypłat w produktach strukturyzowanych: zastosowanie egzotycznych instrumentów pochodnych.
4. Rynek instrumentów pochodnych oraz rynek detalicznych produktów strukturyzowanych.
5. Zastosowanie produktów strukturyzowanych przez inwestorów indywidualnych.
6. Zastosowanie produktów strukturyzowanych przez inwestorów instytucjonalnych.
7. Zastosowanie produktów strukturyzowanych w zarządzaniu ryzykiem przedsiębiorstwa.
8. Instrumenty pochodne, a zarządzanie wartością przedsiębiorstwa.
9. Wycena produktów strukturyzowanych

Metody dydaktyczne:

Metoda podająca, wykład informacyjny, z wykorzystaniem techniki audiowizualnej (folie - rzutnik pisma, slajdy -projektor multimedialny).

Cele przedmiotu:

Przekazanie wiedzy z zakresu innowacyjnych instrumentów finansowych. Przedstawienie sposobów tworzenia produktów strukturyzowanych. Charakterystyka rynku produktów strukturyzowanych oraz opis praktycznego zastosowania produktów strukturyzowanych przez inwestorów. Prezentacja zagadnień związane z wyceną tych instrumentów. Wyrobienie umiejętności analizowania poszczególnych instrumentów strukturyzowanych.

Warunki zaliczenia:

Test po zakończeniu wykładów.

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. Pruchnicka-Grabias I., Egzotyczne opcje finansowe: Systematyka, wycena, strategie, Cedetu, Warszawa 2006
2. Pruchnicka-Grabias I., Inwestycje Alternatywne, Cedetu, Warszawa 2008
3. Materiały dostępne na stronach GPW oraz innych platform internetowych dotyczących produktów strukturyzowanych (m.in. Scoach)
4. Das S., The Swaps & Financial Derivatives Library: Products, Pricing, Applications and Risk Management, John Wiley & Sons, Singapore, 2006:

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Osterreichische Nationalbank, Financial instruments: Structured products handbook, Wien, 2004,
2. Wystup Uwe, FX Options and Structured Products, John Wiley & Sons, England 2006
3. Dieckmann R., Retail certificates: A German success story Market trends, regulatory framework and outlook, EU Monitor 43, Deutsche Bank Research, 19 marzec 2007