

Instrumenty Finansowe

Zadanie

Celem projektu jest wspólne przygotowanie skryptu zawierającego dokładne opisy podstawowych instrumentów finansowych z jakimi spotkać można się na rynkach finansowych. Przewidziany czas realizacji projektu to 4 tygodnie, w trakcie których zrealizowane zostać powinny dwa zadania.

1. W ciągu pierwszych dwóch tygodni trwania projektu student samodzielnie przygotowuje opis przydzielonego mu do realizacji fragmentu skryptu.
2. W ciągu kolejnych dwóch tygodni studenci przygotowujący ten sam fragment skryptu redagują w oparciu o samodzielnie wykonaną pracę uwspólnioną jego wersję.

Za poprawne zrealizowanie projektu uzyskać można łącznie 20 punktów. Przy czym rzetelna realizacja pierwszej części projektu warta jest do 12 punktów, natomiast drugiej jego części 8 punktów.

Pierwsza część projektu oceniana będzie przede wszystkim pod kątem solidnego wykonania zadania, rozumianego głównie w kontekście merytorycznym, ale również estetycznym (poprawny język, przejrzysty układ treści). Ceniona będzie tutaj oryginalność materiału zaprezentowanego przez studenta, względem materiału prezentowanego przez pozostałych studentów omawiających ten sam temat.

Ocena drugiej części projektu uwzględniać będzie te same elementy, które wymieniono przy opisie sposobu oceniania części pierwszej. W razie wątpliwości co do zaangażowania w pracę grupy wszystkich jej członków, możliwe będzie zróżnicowanie ocen na podstawie porównania prac przygotowanych indywidualnie z pracą przygotowaną wspólnie.

Podział tematów

```
set.seed(4846891)

c(
  111615, 153418, 153419, 177028, 148555, 154966, 154974, 177029, 177030,
  177031, 177522, 154994, 155007, 157427, 155034, 148634, 155042, 155044,
  177523, 148643, 155050, 155051, 148649, 155052
) -> indices

c(
  'Wprowadzenie', 'Instrumenty rynku pieniężnego', 'Obligacje', 'Akcje', 'Opcje',
  'Kontrakty terminowe forward i futures', 'Kontrakty swap', 'Indeksy rynku'
) -> subjects

data.frame('NR IND.'=indices, 'TEMAT'=sample(rep(subjects, 3)))
```

| ## | NR.IND. | TEMAT |
|------|---------|---------------------------------------|
| ## 1 | 111615 | Obligacje |
| ## 2 | 153418 | Akcje |
| ## 3 | 153419 | Kontrakty terminowe forward i futures |
| ## 4 | 177028 | Opcje |
| ## 5 | 148555 | Kontrakty swap |

| | | |
|-------|--------|---------------------------------------|
| ## 6 | 154966 | Instrumenty rynku pieniężnego |
| ## 7 | 154974 | Instrumenty rynku pieniężnego |
| ## 8 | 177029 | Wprowadzenie |
| ## 9 | 177030 | Kontrakty swap |
| ## 10 | 177031 | Kontrakty terminowe forward i futures |
| ## 11 | 177522 | Kontrakty swap |
| ## 12 | 154994 | Opcje |
| ## 13 | 155007 | Instrumenty rynku pieniężnego |
| ## 14 | 157427 | Akcje |
| ## 15 | 155034 | Opcje |
| ## 16 | 148634 | Indeksy rynku |
| ## 17 | 155042 | Obligacje |
| ## 18 | 155044 | Obligacje |
| ## 19 | 177523 | Indeksy rynku |
| ## 20 | 148643 | Akcje |
| ## 21 | 155050 | Wprowadzenie |
| ## 22 | 155051 | Wprowadzenie |
| ## 23 | 148649 | Indeksy rynku |
| ## 24 | 155052 | Kontrakty terminowe forward i futures |

Opis tematów

Poniżej zamieszczono wymagania szczegółowe dotyczące każdego z tematów przydzielonych do realizacji. Poza wspomnianymi wymaganiami szczegółowymi, każdy temat musi spełniać pewne wymagania ogólne wymienione poniżej.

- Fragment skryptu realizujący dany temat należy przygotować w postaci pliku RMarkdown.
- Wzory w ramach pliku RMarkdown należy konstruować z wykorzystaniem LaTeXa.
- Plik przygotowywany w ramach pierwszej części projektu należy nazwać numerem swojego indeksu, a ewentualne materiały towarzyszące przekazać w katalogu o takiej samej nazwie.
- Jako nazwę pliku przygotowywanego w ramach drugiej części projektu należy przyjąć nazwę tematu projektu, a ewentualne materiały towarzyszące przekazać w katalogu o takiej samej nazwie.
- Każda praca powinna kończyć się sekcją bibliografii, zawierającą pozycje literaturowe, strony internetowe, prezentacje oraz wszelkie inne źródła wykorzystywane w trakcie realizacji zadania.

Wprowadzenie

Należy:

- zdefiniować pojęcie instrumentu finansowego,
- przedstawić typowe podziały instrumentów finansowych.

Instrumenty rynku pieniężnego

Należy:

- opisać bony skarbowe,
- opisać bony komercyjne,
- opisać certyfikaty depozytowe,
- opisać transakcje repo i reverse repo,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla tych instrumentów.

Obligacje

Należy:

- opisać obligacje,
- przedstawić różne typy obligacji,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla różnych typów obligacji.

Akcje

Należy:

- opisać akcje,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla akcji,
- opisać wybrane wskaźniki związane z akcjami,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla wskaźników.

Opcje

Należy:

- opisać różne typy opcji,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla różnych typów opcji.

Kontrakty terminowe forward i futures

Należy:

- opisać kontrakty terminowe forward i futures,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla kontraktów terminowych.

Kontrakty swap

Należy:

- opisać kontrakty swap,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla różnych kontraktów swap.

Indeksy rynku

Należy:

- zdefiniować pojęcie indeksu rynku,
- przedstawić różne sposoby obliczania indeksów rynku,
- przedstawić przykłady obliczeniowe dla różnych indeksów rynku.

Terminy

- 02.11.2015 - oddanie pierwszej części projektu.
- 16.11.2015 - oddanie drugiej części projektu.

Za oddanie projektu uważa się zrobienie pull requesta zawierającego wykonaną pracę do repozytorium wykładowcy.

Uwagi końcowe

Egzamin z przedmiotu Ekonometria Finansowa może zawierać pytania oraz zadania, które zgodnie z wytycznymi projektu **powinny zostać uwzględnione** w skrypcie powstałym w efekcie jego realizacji. Stwierdzenie to dotyczy zarówno części teoretycznej (definicje, podziały itp.) oraz praktycznej (przykładowe obliczenia) egzaminu.