

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	Analiza i wycena instrumentów finansowych	
AG/O/I/ST/B1.29			Analysis and valuation of financial instruments	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2023/2024		
Kierunek		Analityka Gospodarcza		
w zakresie		-		
Poziom studiów		pierwszego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki,		
Forma studiów		studia stacjonarne		
Semestr / semestry		V		
Przynależność do grupy zajęć		Grupa przedmiotów kierunkowych obowiązkowych		
Status przedmiotu		obowiązkowy		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	15 [h]	2 ECTS
		Ćwiczenia	30 [h]	
		Konwersatorium	[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 / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne		Wszyscy studenci kierunku Analityka Gospodarcza		
Jednostka prowadząca		Katedra Rachunkowości.		
Koordynator		Dr Joanna Bukowska, prof. UTH Rad.		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail, telefon koordynatora		j.bukowska@uthrad.pl (48) 361-74-02		

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

Cel kształcenia:	Celem zajęć z przedmiotu jest zapoznanie słuchaczy z podstawowymi instrumentami finansowymi oraz elementami ich wyceny.
Treści programowe:	<p>Treści zajęć są powiązane z prowadzonymi badaniami naukowymi.</p> <p>Wykład:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Podstawowe informacje o akcjach (dywidenda, modele wyceny akcji, oczekiwana stopa zwrotu, miary ryzyka, podstawowe informacje o analizie fundamentalnej i technicznej) 2. Elementy analizy portfelowej 3. Obligacje, rodzaje, emitenci, wycena obligacji, wartość wewnętrzna, portfel akcji i obligacji 4. Modele wyceny aktywów rynku kapitałowego (CAPM, APT) 5. Kontrakty terminowe (forward, futures, opcje- rodzaje, wycena, model dwumianowy, model Blacka-Scholesa. <p>Ćwiczenia:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Modele wyceny akcji, dochód z akcji, oczekiwana stopa zwrotu, ryzyko-wyznaczanie w oparciu o dane fikcyjne oraz rzeczywiste z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego 2. Wycena obligacji, wartość obligacji, stopa dochodu w okresie do wykupu, ryzyko inwestycji w obligacje, czas trwania obligacji-rozwiązywanie zadań przy wykorzystaniu arkusza kalkulacyjnego 3. Konstrukcja portfela akcji w oparciu o model Markowitza, inne metody konstrukcji portfela 4. Modele rynku kapitałowego: Sharpe'a, linia rynku kapitałowego, modele czynnikowe 5. Opcje, rodzaje, wyznaczanie wartości opcji, model dwumianowy, model Blacka – Scholesa
Metody dydaktyczne (kształcenia):	<p><i>metody podające (wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych z elementami dyskusji);</i></p> <p><i>metody praktyczne (pokaz, ćwiczenia analityczne)</i></p>
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>Wykład – praca pisemna</p> <p>Ćwiczenia - suma ocen: 30% aktywność na zajęciach, 70% ocena z kolokwium pisemnego.</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	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu treści dotyczące instrumentów finansowych oraz metody ich wyceny. Ponadto zna i rozumie w pogłębionym stopniu teorię portfela i modele rynku kapitałowego.	K_W04	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
W2	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu narzędzia i metody wykorzystywane do analizy i wyceny papierów	K_W05	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna

	wartościowych oraz pozyskiwania danych statystycznych.				
U1	Potrafi dokonać wyceny poszczególnych instrumentów finansowych. Potrafi zastosować modele rynku kapitałowego	K_U02	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Kolokwium pisemne
U2	Potrafi wyselekcjonować dane statystyczne oraz wykorzystać narzędzia niezbędne do analizy i wyceny papierów wartościowych	K_U05	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Kolokwium pisemne
K1	Jest gotów do przedstawienia wpływu inwestycji finansowych na efektywność działalności gospodarczej. Ponadto jest gotów do wyjaśnienia zasad i niebezpieczeństw inwestycji w papiery wartościowe.	K_K04	Ćwiczenia	Dyskusja	Aktywność na zajęciach

Literatura i pomoce naukowe	
<ol style="list-style-type: none"> 1. K. Jajuga, T. Jajuga, Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015 2. Z. Śleszyński, Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011. 3. J.E. Bukowska, The degree of integration of the Bulgarian and Croatian equity markets into the eurozone share equity market, European Research Studies Journal, 2021, Volume XXIV, Special Issue 4, s.269-277 4. J.E. Bukowska, The degree of integration of the Bulgarian and Croatian government bond markets into the eurozone government bond market, European Research Studies Journal, 2021, Volume XXIV, Special Issue 4, s. 412-420 	

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	15 [h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X	30 [h]
Udział w konsultacjach	3 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwiczeń/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	3 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	3 [h]/ 0,1 ECTS	3 [h]/ 0,1 ECTS	45 [h]/ 1,8 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	51 [h] / 2 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
Szczegółowe zasady oraz uprawnienia studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością i przewlekłe chorych w zakresie uczestniczenia, przeprowadzania zaliczeń i egzaminów są określone w: Regulaminie studiów, Zasadach studiowania, Procedurze zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością i przewlekłe chorych.