

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		2024/2025			
Kierunek		ANALITYKA GOSPODARCZA			
w zakresie		-			
Poziom studiów		studia pierwszego stopnia			
Profil studiów		ogólnoakademicki			
Forma studiów		studia stacjonarne			
Semestr / semestry		V			
Przynależność do grupy zajęć		Grupa zajęć 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/Warsztaty	30 [h]		
		Konwersatorium	[h]		
		Laboratorium	[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			
Wymagania wstępne					
Jednostka prowadząca		Katedra Finansów Ubezpieczeń i Rachunkowości			
Koordynator		Dr Joanna Bukowska, prof. URad.			
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl			
Adres e-mail koordynatora		j.bukowska@urad.edu.pl			

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

Cel kształcenia:	Celem 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):	metody podające (wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych z elementami dyskusji); metody praktyczne (pokaz, ćwiczenia analityczne)
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</p> <p>Wykład – ocena z pracy pisemnej wystawiona zgodnie z zasadą: 50% i mniej – możliwej do uzyskania liczby punktów – niedostateczny (2) 51-60% – dostateczny (3) 61-70% – dostateczny plus (3,5) 71-80% – dobry (4) 81-90% – dobry plus (4,5) 91-100% – bardzo dobry (5)</p> <p>Ćwiczenia – suma pozytywnych ocen: 20% aktywność na zajęciach, 80% ocena z pracy pisemnej. Ocena wystawiona zgodnie z zasadą: Średnia ważona poniżej 3,0- niedostateczny (2) 3,0 -3,3 – dostateczny (3) 3,4 -3,7 – dostateczny plus (3,5) 3,8 -4,3 – dobry (4) 4,4 -4,7 – dobry plus (4,5) 4,8-5,0 – bardzo dobry (5)</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 wartościowych oraz pozyskiwania danych statystycznych.	K_W05	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
U1	Potrafi dokonać wyceny poszczególnych instrumentów finansowych. Potrafi zastosować modele rynku kapitałowego	K_U02	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
U2	Potrafi wyselekcjonować dane statystyczne oraz wykorzystać narzędzia niezbędne do analizy i wyceny papierów wartościowych	K_U05	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
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	Praca pisemna Aktywność na zajęciach

Literatura i pomoce naukowe
LITERATURA PODSTAWOWA <ol style="list-style-type: none"> 1. H.B. Mayo, Inwestycje, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, druk: 2024 2. 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 3. 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 <p>Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podają 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	15 [h]
Udział w ćwiczeniach/warsztatach/laboratorium	X	X	30 [h]
Udział w konsultacjach	5 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwiczeń/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	5[h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	5 [h]/ 0,2 ECTS	45 [h]/ 1,6 ECTS

Punkty ECTS za przedmiot	55 [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>	