

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

## Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	ANALIZA I WYCENA INSTRUMENTÓW FINANSOWYCH	
E/O/II/ST/B1.37B			ANALYSIS AND VALUATION OF FINANCIAL INSTRUMENTS	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2024/2025		
Kierunek		Ekonomia		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki,		
Forma studiów		studia stacjonarne		
Semestr / semestry		4		
Przynależność do grupy zajęć		B2. Grupa przedmiotów kierunkowych do wyboru		
Status przedmiotu		obieralny		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	[h]	1 ECTS
		Ćwiczenia	[h]	
		Konwersatorium	15 [h]	
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse		0,5 ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse		1 ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne		Brak wymagań		
Jednostka prowadząca		Katedra Polityki Ekonomicznej i Bankowości		
Koordynator		Dr Joanna Bukowska, prof. URad.		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail, telefon koordynatora		j.bukowska@urad.edu.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><b>Treść konwersatoriów:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Modele wyceny akcji, dochód z akcji, oczekiwana stopa zwrotu, ryzyko-wyznaczanie w oparciu o dane fikcyjne oraz rzeczywiste z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego.</li> <li>2. Wycena obligacji, wartość obligacji, stopa dochodu w okresie do wykupu, ryzyko inwestycji w obligacje, czas trwania obligacji-rozwiązanie zadań przy wykorzystaniu arkusza kalkulacyjnego.</li> <li>3. Konstrukcja portfela akcji w oparciu o model Markowitza, inne metody konstrukcji portfela.</li> <li>4. Modele rynku kapitałowego: Sharpe'a, linia rynku kapitałowego, modele czynnikowe.</li> <li>5. Opcje, rodzaje, wyznaczanie wartości opcji, model dwumianowy, model Blacka – Scholesa.</li> </ol>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	<p>metody podające (wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych z elementami dyskusji);</p> <p>metody praktyczne (pokaz, ćwiczenia analityczne)</p>
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>Ocena z konwersatorium stanowi sumę poszczególnych ocen z: 30% aktywność na zajęciach, 70% ocena z kolokwium pisemnego.</p> <p>Ocena z konwersatorium zostanie wystawiona zgodnie z zasadą:</p> <p>50% i mniej – niedostateczny (2)          od 51% do 60% – dostateczny (3)          od 61% do 70% – dostateczny plus (3,5)          od 71% do 80% – dobry (4)          od 81% do 90% – dobry plus (4,5)          od 91% do 100% – bardzo dobry (5)</p> <p>Szczegółowe zasady oraz uprawnienia studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością i przewlekle 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 przewlekle chorych.</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 treści dotyczące instrumentów finansowych oraz ich wyceny. Ponadto zna i rozumie teorię portfela i modele rynku kapitałowego.	K_W04	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Kolokwium pisemne

W2	Zna i rozumie narzędzia i metody wykorzystywane do analizy i wyceny papierów wartościowych oraz pozyskiwania danych statystycznych.	K_W06	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Kolokwium pisemne
U1	Potrafi dokonać wyceny poszczególnych instrumentów finansowych. Potrafi zastosować modele rynku kapitałowego	K_U02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Kolokwium pisemne
U2	Potrafi wyselekcjonować dane statystyczne oraz wykorzystać narzędzia niezbędne do analizy i wyceny papierów wartościowych	K_U05	Konwersatorium	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	konwersatorium	Dyskusja	Aktywność na zajęciach

Literatura i pomoce naukowe	
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Sopoćko, A., Rynkowe instrumenty finansowe, PWN, Warszawa 2019</li> <li>2. H.B. Mayo, Inwestycje, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, druk: 2024</li> <li>1. 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</li> <li>2. 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</li> </ol>	

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	[h]
Udział w konsultacjach	2 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwiczeń/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	8 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	2 [h]/ 0,1 ECTS	8[h]/ 0,3 ECTS	15 [h]/ 0,6 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	25 [h] / 1 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
W przypadku studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekłe chorych, określone powyżej (w karcie) metody i formy weryfikacji efektów uczenia się dostosowuje się odpowiednio do indywidualnych potrzeb tych studentów.

