

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Opis przedmiotu

| | | | | |
|---|---------------------------------|--|-----------------------------------|---------------------|
| Kod przedmiotu | Nazwa przedmiotu | Strategie inwestycyjne na rynku finansowym | | |
| AG/A/1(1)/NS/C36b | | Investment strategies on the financial market | | |
| Język wykładowy | | polski | | |
| Rok akademicki | | 2020/2021 | | |
| | | | | |
| Kierunek | Analityka gospodarcza | | | |
| Poziom studiów | studia pierwszego stopnia | | | |
| Profil studiów | ogólnoakademicki | | | |
| Forma studiów | studia stacjonarne | | | |
| Semestr / semestry | 4 | | | |
| | | | | |
| Przynależność do grupy zajęć | Przedmiot z grupy: kierunkowych | | | |
| Status przedmiotu | obieralny | | | |
| Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS | | Forma zajęć | Liczba godzin zajęć dydaktycznych | Liczba punktów ECTS |
| | | Wykład | ... [h] | 2 ECTS |
| | | Ćwiczenia | ...[h] | |
| | | Konwersatorium | 15[h] | |
| Powiązanie przedmiotu | z profilem studiów | • związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie do której przyporządkowany jest kierunek studiów (profil ogólnoakademicki) | | 1 ECTS |
| | z dyscypliną | Ekonomia i finanse | | 2 ECTS |
| Forma nauczania | | tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni | | |
| Wymagania wstępne | | Wszyscy studenci kierunku Finanse i rachunkowość | | |
| | | | | |
| Jednostka prowadząca | | Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych | | |
| Koordynator | | Dr Joanna Bukowska | | |
| Adres strony internetowej pjo | | www.uniwersytetradom.pl | | |
| Adres e-mail, telefon koordynatora | | j.bukowska@uthrad.pl , +48 361 74 92 | | |

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

| | |
|--------------------|---|
| Cel kształcenia: | <i>Celem zajęć z przedmiotu jest zapoznanie się z metodami i zasadami wyceny inwestycji finansowych oraz próba ich modelowania.</i> |
| Treści programowe: | <p>I. Wprowadzenie do strategii inwestycyjnych na rynku finansowym (2h)</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Istota strategii inwestycyjnych 2. Rodzaje strategii inwestycyjnych 3. Czynniki wpływające na wybór strategii inwestycyjnych 4. Ryzyko inwestowania na rynku finansowym <p>II. Podstawowe zasady analizy technicznej (6h)</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Cel i założenia analizy technicznej, 2. Horyzont inwestycyjny analizy technicznej 3. Rodzaje trendów i wykresów 4. Formacje sygnalizujące odwrócenie lub kontynuację trendu 5. Wskaźniki analizy technicznej <p>III. Analiza fundamentalna (6h)</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Cel i założenia analizy fundamentalnej 2. Horyzont inwestycyjny analizy fundamentalnej 3. Elementy analizy fundamentalnej |

| | |
|--|--|
| | 4. Źródła informacji i danych w analizie fundamentalnej IV. Zarządzanie portfelem obligacji (4h) V. Strategie inwestowania z wykorzystaniem instrumentów pochodnych (4h) VI. Ocena rentowności inwestycji finansowej (3h) VII. Modele oczekiwań w finansach (3h) VIII. Praca audytoryjna (2h) |
| Metody dydaktyczne (kształcenia): | Wykład informacyjny i problemowy, dyskusja dydaktyczna, zadania indywidualne lub grupowe. |
| 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 danego przedmiotu. Uzyskanie pozytywnych ocen ze wszystkich form zajęć wchodzących w skład danego przedmiotu jest równoznaczne z jego zaliczeniem i zdobyciem przez studenta liczby punktów ECTS przyporządkowanej temu przedmiotowi. Sposób obliczenia oceny końcowej z przedmiotu określa regulamin studiów.</p> <p>Zaliczenie na podstawie:</p> <ul style="list-style-type: none"> - praca pisemna, - aktywność na zajęciach, - obecność na zajęciach. |

| 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 | Ma wiedzę na temat istoty, rodzajów oraz czynników, które mają wpływ na wybór strategii inwestycyjnej. Ponadto zna podstawowe modele wyceny inwestycji finansowych | K_W01 K_W05 K_W07 | konwersatorium | zaliczenie na ocenę | praca pisemna |
| W2 | Posiada rozszerzoną wiedzę na temat analizy technicznej i fundamentalnej. Ich istoty, celów, elementów czy formacji. | K_W05 K_W07 K_W08 | konwersatorium | zaliczenie na ocenę | praca pisemna |
| U1 | Swobodnie wykorzystuje techniki inwestycyjne takie jak analiza techniczna i fundamentalna | K_U02 K_U04 | konwersatorium | zaliczenie na ocenę | praca pisemna, aktywność na zajęciach |
| U2 | Potrafi zebrać niezbędne dane statystyczne oraz dokonać ich selekcji. Ponadto potrafi wykorzystać arkusz kalkulacyjny w obliczeniach finansowych | K_U02 K_U05 | konwersatorium | zaliczenie na ocenę | praca pisemna, aktywność na zajęciach |
| K1 | Zna ograniczenia własnej wiedzy z zakresu strategii inwestycyjnych i rozumie potrzebę dalszego kształcenia. Jest świadomy konieczności śledzenia i analizy zjawisk zachodzących na rynkach finansowych. | K_K01 K_K02 | konwersatorium | zaliczenie na ocenę | dyskusja, aktywność na zajęciach |

| Literatura podstawowa, literatura uzupełniająca, pomoce naukowe |
|--|
| Literatura podstawowa: <ul style="list-style-type: none"> • Elder A. Sprzedaż i krótka sprzedaż, Oficyna Wolters Kluwer business, Warszawa 2013. • Haugen R. A. Teoria nowoczesnego inwestowania, WIG Press, Warszawa 1996. • Nowakowski W. E. Krótka sprzedaż a efektywność rynku kapitałowego, Oficyna Wydawnicza Politechniki |

Warszawskiej, Warszawa 2010.

- Osieńska M. *Ekonometryczne modelowanie oczekiwań gospodarczych*, Wydawnictwo Uniwersytetu Mikołaja Kopernika, Toruń 2000.
- Pring M. I., *Psychologia inwestowania*, Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2006.
- Reilly F.K., Brown K.C., *Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem*, tom I, II, PWE, Warszawa 2001.
- Z. Śleszyński, *Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka*, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011.
- Tarczyński W. *Rynki kapitałowe*, tom I, Agencja Wydawnicza Placet, Warszawa 1997.
- Tarczyński W., Zwolankowski M., *Inżynieria finansowa*, Agencja Wydawnicza Placet, Warszawa 1999.

Literatura uzupełniająca:

- K Jajuga, T Jajuga, *Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa*, PWN, Warszawa 2015.
- Piasecki K., Ronka-Chmielowiec W., *Matematyka finansowa*, Wydawnictwo C.H. Beck, Warszawa 2011.
- Weron A. Weron R. [1999], *Inżynieria finansowa Wycena instrumentów pochodnych Symulacje komputerowe Statystyka rynku*, Wydawnictwa Naukowo – Techniczne, Warszawa.

Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podaje prowadzący

| 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 | X | X | [h] |
| Udział w ćwiczeniach / ćwiczeniach laboratoryjnych / projektach / seminariach | X | X | 15 [h] |
| Udział w konsultacjach | 5[h] | X | X |
| Samodzielne przygotowanie się do wykładów/ ćwiczeń/ ćwiczeń laboratoryjnych / projektów / seminariów/ zaliczenia i egzaminu | X | 30[h] | X |
| Sumaryczne obciążenie pracą studenta | 5 [h]/ 0,2ECTS | 30 [h]/1,2 ECTS | 15[h]/0,6 ECTS |
| Punkty ECTS za przedmiot | 2ECTS | | |

Samodzielne przygotowanie się do ćwiczeń/ ćwiczeń laboratoryjnych / projektów / seminariów

| Informacje dodatkowe, uwagi |
|-----------------------------|
| |