

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Opis przedmiotu

| | | | |
|---|--|--|---------------------|
| Kod przedmiotu | Nazwa przedmiotu | Analiza i wycena instrumentów finansowych | |
| AG/A/1(I)/S/29 | | Analysis and valuation of financial instruments | |
| Język wykładowy | polski | | |
| Rok akademicki | 2020/2021 | | |
| | | | |
| Kierunek | Analityka gospodarcza | | |
| Poziom studiów | studia pierwszego stopnia | | |
| Profil studiów | ogólnoakademicki | | |
| Forma studiów | studia stacjonarne | | |
| Semestr / semestry | 5 | | |
| | | | |
| Przynależność do grupy zajęć | Przedmiot z grupy: B | | |
| Status przedmiotu | Obowiązkowy | | |
| Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS | Forma zajęć | Liczba godzin zajęć dydaktycznych | Liczba punktów ECTS |
| | Wykład | 15[h] | 3ECTS |
| | Ćwiczenia | 30[h] | |
| | ... | ... | |
| Powiązanie przedmiotu | z profilem studiów | • związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie do której przyporządkowany jest kierunek studiów (profil ogólnoakademicki) | 0,5 ECTS |
| | z dyscypliną | Ekonomia i finanse | 3 ECTS |
| Forma nauczania | tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni | | |
| Wymagania wstępne | Wszyscy studenci kierunku Analityka gospodarcza | | |
| | | | |
| Jednostka prowadząca | Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych | | |
| Koordynator | Dr Zbigniew Śleszyński | | |
| Adres strony internetowej pjo | www.uniwersytetradom.pl | | |
| Adres e-mail, telefon koordynatora | z.sleszynski@uthrad.pl 483617463 | | |

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

| | |
|--------------------|--|
| Cel kształcenia: | <i>Celem zajęć z przedmiotu jest zapoznanie słuchaczy z podstawowymi instrumentami finansowymi oraz elementami ich wyceny.</i> |
| Treści programowe: | <p>Wykład:</p> <ul style="list-style-type: none"> Podstawowe informacje o akcjach ((dywidenda, modele wyceny akcji, oczekiwana stopa zwrotu, miary ryzyka, podstawowe informacje o analizie fundamentalnej i technicznej.(4h, BN, W1, W2) Elementy analizy portfelowej .(3h, BN, W2) Obligacje, rodzaje, emitenci, wycena obligacji, wartość wewnętrzna, portfel akcji i obligacji .(4h, W1, W2) Modele wyceny aktywów rynku kapitałowego (CAPM, APT) .(2 h,W1, W2) Kontrakty terminowe (forward, futures, opcje- rodzaje, wycena, model dwumianowy, model Blacka-Scholesa. .(2 h, W1, W2) <p>Ćwiczenia:</p> <ul style="list-style-type: none"> Modele wyceny akcji, dochód z akcji, oczekiwana stopa zwrotu, ryzyko-wyznaczanie w oparciu o dane fikcyjne oraz rzeczywiste z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego. .(8h., W2,U1, U2, U3, K1, K2, K3). Wycena obligacji, wartość obligacji, stopa dochodu w okresie do wykupu, ryzyko inwestycji w obligacje, czas |

| | |
|--|--|
| | <p>trwania obligacji-rozwiazywanie zadan przy wykorzystaniu arkusza kalkulacyjnego.(6 h, W1, W2, U1, U3 K1, K2, K3).</p> <ul style="list-style-type: none"> Konstrukcja portfela akcji w oparciu o model Markowitza, inne metody konstrukcji portfela.(6h, W2, U1, U3, K1, K2, K3). Modele rynku kapitałowego: Sharpe'a, linia rynku kapitałowego, modele czynnikowe. .(4 h, W2, U1, U3, K1, K2, K3). Opcje, rodzaje, wyznaczanie wartości opcji, model dwumianowy, model Blacka – Scholesa.(4 h, W2, U1, U2, U3, K1, K2, K3). Praca audytoryjna. .(2 h.), |
| Metody dydaktyczne (kształcenia): | <p>Wykład: prezentacja multimedialna), kontrolowana dyskusja, rozwiązywanie zadań praktycznych</p> <p>Ćwiczenia: metoda przypadków, rozwiązywanie zadań praktycznych (z wykorzystaniem komputera)</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 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>Sposób obliczania oceny z poszczególnych form zajęć przedstawia się następująco:</p> <p>Wykład (zal)- warunkiem zaliczenia jest posiadanie zaliczonych ćwiczeń.</p> <p>Zaliczenie ćwiczeń ma postać testu jednokrotnego wyboru z karami za niepoprawne odpowiedzi. Test składa się z 9 zadań (pytań). Za każde pytanie można otrzymać 3 pkt, -3 pkt, -2 pkt, -1 pkt, 0 pkt. Warunkiem zaliczenia testu jest otrzymanie 11 pkt.</p> <p>Ćwiczenia – ocena końcowa z ćwiczeń stanowi sumę ocen: 90% test, 10%, aktywności na zajęciach.</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 instrumenty notowane na rynkach finansowych | K_W01 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| W2 | Zna zasady wyceny głównych instrumentów finansowych | K_W05 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| U1 | Potrafi wycenić akcje, obligacje | K_U02 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| U2 | Potrafi wymienić rodzaje opcji, umie je wyceniać | K_U02 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| U3 | potrafi wykorzystać arkusz kalkulacyjny do wyceny instrumentów finansowych | K_U02 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| U4 | Potrafi wycenić stopę zwrotu i ryzyko portfela akcji | K_U02 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| K1 | zna ograniczenia własnej wiedzy z zakresu instrumentów finansowych i jest gotów do dalszego kształcenia | K_K01 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |
| K2 | Jest gotów do wyjaśnienia zasad i niebezpieczeństw inwestycji w papiery | K_K04 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |

| | | | | | |
|-----------|---|-------|-------------------|------------|--------------------|
| | wartościowe | | | | |
| K3 | Jest gotów do przedstawienia wpływu inwestycji finansowych na efektywność działalności gospodarczej | K_K04 | Wykład, ćwiczenia | Kolokwium, | Zaliczenie testowe |

Literatura podstawowa, literatura uzupełniająca, pomoce naukowe

Literatura podstawowa:

- K Jajuga, T Jajuga, Inwestycje, instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN, Warszawa 2004.
- W. Tarczyński, M. Zwołankowski, Inżynieria finansowa, instrumentarium, strategie, zarządzanie ryzykiem, Agencja Wydawnicza Placet, Warszawa 1999.
- M. Rutkowski (red), Matematyka finansowa, instrumenty pochodne, WNT, Warszawa 2003.
- Weron, R. Weron, Inżynieria finansowa. Wycena instrumentów pochodnych. Symulacje komputerowe. Statystyka rynku, WNT 1998.
- Z. Śleszyński, A. Śleszyńska, Podstawy matematyki finansowej z elementami teorii portfelowej, Politechnika Radomska, Radom 2007, (maszynopis powielony).
- Z. Śleszyński, Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011.
- Z. Śleszyński, Wybrane zagadnienia z podstaw arytmetyki finansowej, Wydawnictwo Uniwersytetu Technologiczno-Humanistycznego, Radom 2018.

Literatura uzupełniająca:

- W. Dębski, Rynek finansowy i jego mechanizmy. Podstawy teorii i praktyki, PWN Warszawa 2010.
- A. Sopoćko, Rynkowe instrumenty finansowe, PWN Warszawa 2005.
- W. Waluś, Inżynieria finansowa, <http://mst.mimuw.edu.pl/wyklady/ifi/wyklad.pdf>, Uniwersytet Warszawski, Warszawa 2011

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 | 15 [h] |
| Udział w ćwiczeniach / ćwiczeniach laboratoryjnych / projektach / seminariach | X | X | 30 [h] |
| Udział w konsultacjach | 5 [h] | X | X |
| Samodzielne przygotowanie się do wykładów/ ćwiczeń/ ćwiczeń laboratoryjnych / projektów / seminariów/ zaliczenia i egzaminu | X | 25 [h] | X |
| Sumaryczne obciążenie pracą studenta | 5 [h]/ 0,2 ECTS | 25 [h]/ 1 ECTS | 45 [h]/ 1,8 ECTS |
| Punkty ECTS za przedmiot | 3 ECTS | | |

Informacje dodatkowe, uwagi