

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

## Opis przedmiotu

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu	Nazwa przedmiotu	Strategie inwestycyjne na rynku finansowym		
AG/A/1(1)/S/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	30 [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		<a href="http://www.uniwersytetradom.pl">www.uniwersytetradom.pl</a>		
Adres e-mail, telefon koordynatora		<a href="mailto:j.bukowska@uthrad.pl">j.bukowska@uthrad.pl</a> , +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"> <li>1. Istota strategii inwestycyjnych</li> <li>2. Rodzaje strategii inwestycyjnych</li> <li>3. Czynniki wpływające na wybór strategii inwestycyjnych</li> <li>4. Ryzyko inwestowania na rynku finansowym</li> </ol> <p>II. Podstawowe zasady analizy technicznej (6h)</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Cel i założenia analizy technicznej,</li> <li>2. Horyzont inwestycyjny analizy technicznej</li> <li>3. Rodzaje trendów i wykresów</li> <li>4. Formacje sygnalizujące odwrócenie lub kontynuację trendu</li> <li>5. Wskaźniki analizy technicznej</li> </ol> <p>III. Analiza fundamentalna (6h)</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Cel i założenia analizy fundamentalnej</li> <li>2. Horyzont inwestycyjny analizy fundamentalnej</li> <li>3. Elementy analizy fundamentalnej</li> <li>4. Źródła informacji i danych w analizie fundamentalnej</li> </ol>

	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:	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. Zaliczenie na podstawie: - 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	
<b>Literatura podstawowa:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>Elder A. Sprzedaż i krótka sprzedaż, Oficyna Wolters Kluwer business, Warszawa 2013.</li> <li>Haugen R. A. Teoria nowoczesnego inwestowania, WIG Press, Warszawa 1996.</li> <li>Nowakowski W. E. Krótka sprzedaż a efektywność rynku kapitałowego, Oficyna Wydawnicza Politechniki Warszawskiej, Warszawa 2010.</li> <li>Osińska M. Ekonometryczne modelowanie oczekiwań gospodarczych, Wydawnictwo Uniwersytetu</li> </ul>	

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

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

Informacje dodatkowe, uwagi