

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		2025/2026		
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>Treść konwersatoriów:</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-rozwiązanie 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>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 przewlekłe 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 przewlekłe 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"> 1. Sopoćko, A., Rynkowe instrumenty finansowe, PWN, Warszawa 2019 2. H.B. Mayo, Inwestycje, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, druk: 2024 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 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

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/ćwicz/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, przewlekle chorych, określone powyżej (w karcie) metody i formy weryfikacji efektów uczenia się dostosowuje się odpowiednio do indywidualnych potrzeb tych studentów.