

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	ANALIZA I WYCENA INSTRUMENTÓW FINANSOWYCH	
FiR/O/II/S/B2.36a			ANALYSIS AND VALUATION OF FINANCIAL INSTRUMENTS	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2025/2026		
Kierunek		Finanse i Rachunkowość		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogolnoakademicki		
Forma studiów		studia stacjonarne		
Semestr / semestry		III		
Przynależność do grupy zajęć		Grupa kierunkowych obieralnych		
Status przedmiotu		Obieralny		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	[h]	2 ECTS
		Ćwiczenia/Warsztaty	[h]	
		Konwersatorium	30 [h]	
		Laboratorium		
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	Związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse		1 ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse		2 ECTS
Forma nauczania		Tradycyjna - zajęcia zorganizowane w Uczelni / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne				
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
Koordynator		Dr Joanna Bukowska, prof. URad.		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail koordynatora		j.bukowska@urad.edu.pl		

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

Cel kształcenia:	Celem 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> <p>Modele wyceny akcji, dochód z akcji, oczekiwana stopa zwrotu, ryzyko-wyznaczanie w oparciu o dane fikcyjne oraz rzeczywiste z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego.</p> <p>Wycena obligacji, wartość obligacji, stopa dochodu w okresie do wykupu, ryzyko inwestycji w obligacje, czas trwania obligacji-rozwijanie zadań przy wykorzystaniu arkusza kalkulacyjnego.</p> <p>Konstrukcja portfela akcji w oparciu o model Markowitza, inne metody konstrukcji portfela.</p> <p>Modele rynku kapitałowego: Sharpe’a, linia rynku kapitałowego, modele czynnikowe.</p> <p>Opcje, rodzaje, wyznaczanie wartości opcji, model dwumianowy, model Blacka – Scholesa.</p>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	metody podające (wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych z elementami dyskusji); metody praktyczne (pokaz, ćwiczenia analityczne) obserwacja
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu. Konwersatorium – suma ocen: 20% poziom realizacji kompetencji społecznych, 80% projekt.

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 w pogłębionym stopniu teorie portfela i modele rynku kapitałowego.	K_W04	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt
W2	Zna i rozumie narzędzia i metody wykorzystywane do analizy i wyceny papierów wartościowych oraz pozyskiwania danych statystycznych.	K_W05	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt
U1	Potrafi dokonać wyceny poszczególnych instrumentów finansowych. Potrafi zastosować modele rynku kapitałowego	K_U02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt
U2	Potrafi wyselekcjonować dane statystyczne oraz wykorzystać narzędzia niezbędne do analizy i wyceny papierów wartościowych	K_U04	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt

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_K02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Aktywność na zajęciach Obserwacja
----	---	-------	----------------	---------------------	--------------------------------------

Literatura i pomoce naukowe					
LITERATURA PODSTAWOWA					
<ol style="list-style-type: none"> 1. H.B. Mayo, Inwestycje, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, druk: 2024 2. 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 3. 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 					
Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podają 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/konwersatoriach	X	X	30 [h]
Udział w ćwiczeniach/warsztatach/laboratorium	X	X	[h]
Udział w konsultacjach	2 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab- 2[h]	X	18 [h]	X
Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu - 1[h]			
Przygotowanie projektu – 15[h]			
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	2 [h] / 0,1 ECTS	18 [h] / 0,7 ECTS	30 [h] / 1,2 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	50 [h] / 2 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
<p>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.</p> <p>Szczegółowe zasady i formy wsparcia studentów ze szczególnymi potrzebami: w tym z niepełnosprawnością, przewlekle chorych podczas zajęć, zaliczeń i egzaminów określono w: Regulaminie Studiów, Zasadach Studiowania, Procedurze dotyczącej zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych.</p>