

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	Wycena i analiza instrumentów finansowych	
IAwB/O/I/NST/B.1-29			Valuation an analysis d of financial Instruments	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2025/2026		
Kierunek		Informatyka i Analityka w Biznesie		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia pierwszego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki		
Forma studiów		studia niestacjonarne		
Semestr / semestry		semestr V		
Przynależność do grupy zajęć		B1. Grupa zajęć kierunkowych obowiązkowych		
Status przedmiotu		Obowiązkowy		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	10 [h]	3 ECTS
		Ćwiczenia	15 [h]	
		Konwersatorium	[h]	
		Laboratorium	[h]	
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	Związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie Nauki o zarządzaniu i jakości		2 ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Nauki o zarządzaniu i jakości		3 ECTS
Forma nauczania		Tradycyjna - zajęcia zorganizowane w Uczelni/ Z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne		Wiedza, umiejętności i kompetencje społeczne realizowane w ramach przedmiotu Rynki finansowe.		
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
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) 361-74-98		

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>Treści wykładów:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Podstawowe informacje o akcjach (dywidenda, modele wyceny akcji, oczekiwana stopa zwrotu, miary ryzyka, podstawowe informacje o analizie fundamentalnej i technicznej) 2. Elementy analizy portfelowej 3. Obligacje, rodzaje, emitenci, wycena obligacji, wartość wewnętrzna, portfel akcji i obligacji 4. Modele wyceny aktywów rynku kapitałowego (CAPM, APT) 5. Kontrakty terminowe (forward, futures, opcje- rodzaje, wycena, model dwumianowy, model Blacka-Scholesa). <p>Treść ćwiczeń:</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-rozwiązywanie 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):	<p>– metody podające (wykład informacyjny),</p> <p>– metody praktyczne (modele wyceny instrumentów finansowych, analiza portfelowa),</p> <p>– arkusz kalkulacyjny - Microsoft Excel,</p> <p>– obserwacja.</p>
	<p>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla 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 określony został zarządzeniem Rektora URad.</p> <p>Wykład – 100% ocena z pracy pisemnej, zaliczenie mogą uzyskać wyłącznie studenci, którzy uzyskają zaliczenie z ćwiczeń.</p> <p>Ćwiczenia – suma pozytywnych ocen: 20% poziom realizacji kompetencji społecznych, 80% ocena z pracy pisemnej.</p> <p>Ocena stopnia osiągnięcia wymaganych kompetencji społecznych jest wynikiem oceny przeprowadzanej przez prowadzącego zajęcia na podstawie:</p> <ul style="list-style-type: none"> - oceny aktywności studenta na zajęciach, - oceny na podstawie obserwacji bezpośredniej elementów: komunikacja, współpraca, rozwiązywanie problemów.

	<p>Ocena końcowa z ćwiczeń może zostać podwyższona o 0,5 stopnia w sytuacji wysokiej aktywności studenta podczas zajęć.</p> <p>Ocena z przedmiotu: Poniżej 50% zdobytych punktów - 2,0 51% - 64% – 3,0 65% - 74% – 3,5 75% - 84% - 4,0 85% - 94% - 4,5 95% - 100% - 5,0</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 metody ich wyceny. Ponadto zna i rozumie w pogłębionym stopniu teorię portfela i modele rynku kapitałowego.	K_W02	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
W2	Zna i rozumie narzędzia i metody wykorzystywane do analizy i wyceny papierów wartościowych oraz pozyskiwania danych statystycznych	K_W05	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna
U1	Potrafi dokonać wyceny poszczególnych instrumentów finansowych. Potrafi zastosować modele rynku kapitałowego	K_U01	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna, aktywność na zajęciach
U2	Potrafi wyselekcjonować dane statystyczne oraz wykorzystać narzędzia niezbędne do analizy i wyceny papierów wartościowych	K_U04	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Praca pisemna, aktywność na zajęciach
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_K01	Ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Obserwacja, aktywność na zajęciach obserwacja

Literatura i pomoce naukowe
<p>Literatura podstawowa:</p> <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 <p>Literatura uzupełniająca:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Bazy danych statystycznych: https://www.gpw.pl/, https://stooq.pl/ <p>Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podają prowadzący.</p>

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	10 [h]
Udział w ćwiczeniach/warsztatach/laboratorium	X	X	15 [h]
Udział w konsultacjach	2 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab - 20[h] Przygotowanie do zaliczenia – 28 [h]	X	48 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	2 [h] / 0,1 ECTS	48 [h] / 1,9 ECTS	25 [h] / 1 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	75 [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>