

WYDZIAŁ INFORMATYKI I ZARZĄDZANIA**KARTA PRZEDMIOTU****Nazwa w języku polskim Rynek kapitałowy II****Nazwa w języku angielskim Models for capital market analysis****Kierunek studiów (jeśli dotyczy): Zarządzanie****Specjalność (jeśli dotyczy): Zarządzanie finansami (ZF)****Stopień studiów i forma: II stopień, niestacjonarna****Rodzaj przedmiotu: obowiązkowy****Kod przedmiotu FBZ1199****Grupa kursów NIE**

	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium
Liczba godzin zajęć zorganizowanych w Uczelni (ZZU)	10		10		
Liczba godzin całkowitego nakładu pracy studenta (CNPS)	30		60		
Forma zaliczenia	zaliczenie na ocenę		zaliczenie na ocenę		
Dla grupy kursów zaznaczyć kurs końcowy (X)					
Liczba punktów ECTS	1		2		
w tym liczba punktów odpowiadająca zajęciom o charakterze praktycznym (P)			2		
w tym liczba punktów ECTS odpowiadająca zajęciom wymagającym bezpośredniego kontaktu (BK)	0,33		0,33		

*niepotrzebne skreślić

WYMAGANIA WSTĘPNE W ZAKRESIE WIEDZY, UMIEJĘTNOŚCI I INNYCH KOMPETENCJI

1. Umiejętność modelowania w arkuszu kalkulacyjnym Excel
2. Znajomość podstaw rachunku prawdopodobieństwa i statystyki matematycznej
3. Zaliczony przedmiot „Rynek kapitałowy”

CELE PRZEDMIOTU

C1 – Przegląd instrumentów finansowych ze szczególnym uwzględnieniem instrumentów rynku kapitałowego.

C2 – Wykształcenie praktycznych umiejętności budowy modeli analitycznych i symulacyjnych umożliwiających wycenę, pomiar stopy dochodu i analizę ryzyka przy inwestowaniu w papiery dłużne, udziałowe oraz instrumenty pochodne.

C3 – Wykształcenie praktycznych umiejętności pomiaru i maksymalizacji efektywności inwestycji przy wykorzystaniu teorii portfela.

PRZEDMIOTOWE EFEKTY KSZTAŁCENIA

Z zakresu wiedzy:

PEK_W01 Zna specjalistyczne zaawansowane metody statystyczne, analityczne i symulacyjne służące do pomiaru i maksymalizacji efektywności inwestycji.

Z zakresu umiejętności:

PEK_U01 Potrafi zbudować modele analityczne i symulacyjne oraz przeprowadzać analizy służące wycenie, określaniu stopy dochodu, oraz identyfikacji strategii inwestowania.

PEK_U02 Identyfikuje ryzyko w procesach podejmowania decyzji inwestycyjnych. Potrafi stosować metody pomiaru i zarządzania ryzykiem używając różnego typu narzędzi inżynierii finansowej.

TREŚCI PROGRAMOWE

Forma zajęć - wykład		Liczba godzin
Wy1	Przedstawienie wymagań i regulaminu zajęć. Przypomnienie podstawowych pojęć związanych z rynkiem finansowym. Wycena i analiza obligacji. Ryzyko inwestowania w obligacje	2
Wy2	Wycena akcji. Dochód i ryzyko inwestowania w akcje	2
Wy3	Maksymalizacja efektywności inwestycji za pomocą teorii portfela Wycena aktywów kapitałowych	2
Wy4	Wycena i analiza instrumentów pochodnych	2
Wy5	Kolokwium zaliczeniowe	2
	Suma godzin	10

Forma zajęć - ćwiczenia		Liczba godzin
Ćw1		
Ćw2		
Ćw3		
	Suma godzin	

Forma zajęć - laboratorium		Liczba godzin
La1	Przedstawienie wymagań i regulaminu zajęć Model wyceny obligacji: wyznaczanie krzywej rentowności, szacowanie ryzyka	2
La2	Model analityczny wyceny akcji: model zdyskontowanych dywidend Model symulacyjny wyceny akcji: model błędzenia geometrycznego	2
La3	Teoria portfela: budowa portfela z uwzględnieniem instrumentów ryzykownych i pozbawionych ryzyka	2
La4	Model analityczny i model symulacyjny wyceny opcji	2
La5	Zaliczenie	2
	Suma godzin	10

Forma zajęć - projekt		Liczba godzin
Pr1		
Pr2		

Pr3		
	Suma godzin	

Forma zajęć - seminarium		Liczba godzin
Se1		
Se2		
Se3		
	Suma godzin	

STOSOWANE NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE
N1. Prezentacja multimedialna N2. Arkusz kalkulacyjny

OCENA OSIĄGNIĘCIA PRZEDMIOTOWYCH EFEKTÓW KSZTAŁCENIA

Oceny (F – formująca (w trakcie semestru), P – podsumowująca (na koniec semestru))	Numer efektu kształcenia	Sposób oceny osiągnięcia efektu kształcenia
F1	PEK_U01 PEK_U02	Zadanie cząstkowe nr 1
F2	PEK_U01 PEK_U02	Zadanie cząstkowe nr 2
F3	PEK_U01 PEK_U02	Zadanie cząstkowe nr 3
F4	PEK_U01 PEK_U02	Zadanie cząstkowe nr 4
P: kolokwium zaliczeniowe PEK_W01		

LITERATURA PODSTAWOWA I UZUPEŁNIAJĄCA
<p><u>LITERATURA PODSTAWOWA:</u></p> <p>[1] Jajuga K., Jajuga T., <i>Inwestycje. Instrumenty finansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa.</i>, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2001</p> <p>[2] Holden C.W., <i>Excel modeling in investments</i>, Pearson Education, 2012</p> <p>[3] Wilimowska Z., <i>Metodyka budowy efektywnego portfela projektów inwestycyjnych</i>, Oficyna Wydawnicza Politechniki Wrocławskiej, Wrocław 1997.</p> <p><u>LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:</u></p> <p>[1] Mielczarek B., <i>Modelowanie symulacyjne w zarządzaniu. Symulacja dyskretna</i>. Oficyna Wydawnicza PWr Wrocław 2009</p>
OPIEKUN PRZEDMIOTU (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL)
Bożena Mielczarek bozena.mielczarek@pwr.wroc.pl

MACIERZ POWIĄZANIA EFEKTÓW KSZTAŁCENIA DLA PRZEDMIOTU
Rynek kapitałowy II
Z EFEKTAMI KSZTAŁCENIA NA KIERUNKU Zarządzanie
I SPECJALNOŚCI Zarządzanie finansami (ZF)

Przedmiotowy efekt kształcenia	Odniesienie przedmiotowego efektu do efektów kształcenia zdefiniowanych dla kierunku studiów i specjalności (o ile dotyczy)**	Cele przedmiotu***	Treści programowe***	Numer narzędzia dydaktycznego***
PEK_W01 (wiedza)	S2_IZF_W04	C1	WY1- WY4	N1
PEK_U01 (umiejętności)	S2_IZF_U05	C2, C3	LA1- LA4	N1, N2
PEK_U02	S2_IZF_U06	C2, C3	LA1-LA4	N1, N2

** - wpisać symbole kierunkowych/specjalnościowych efektów kształcenia

*** - z tabeli powyżej