



Sylabus przedmiotu – część A
Inwestycje na rynku finansowym

12S2O-INRF

ECTS: 2.0

CYKL: 2021Z

TREŚCI MERYTORYCZNE

WYKŁAD

Rynek finansowy - istota, struktura, funkcje. Instrumenty finansowe i inne aktywa inwestycyjne. Stopa zwrotu i ryzyko w działalności inwestycyjnej. Tworzenie portfela papierów wartościowych. Psychologiczne i społeczne uwarunkowania decyzji inwestycyjnych.

ĆWICZENIA

Papiery wartościowe na rynku kapitałowym - istota, wycena. Wyznaczanie stóp zwrotu z akcji i indeksu. Podstawowe narzędzia statystyczne. Zależność pomiędzy stopą zwrotu z akcji a stopą zwrotu z portfela rynkowego - linia charakterystyczna, współczynnik Beta. Tworzenie portfela akcji - ryzyko i oczekiwana stopa zwrotu z portfela, linie kombinacji. Wyznaczanie zbioru efektywnego. Wybrane modele wskaźnikowe. Weryfikacja efektywności informacyjnej rynku. Zjawiska anomalne na rynku giełdowym.

CEL KSZTAŁCENIA

Celem jest przekazanie wiedzy z zakresu zarządzania inwestycjami w instrumenty rynku kapitałowego.

OPIS EFEKTÓW UCZENIA SIĘ PRZEDMIOTU W ODNIESIENIU DO OPISU

CHARAKTERYSTYK DRUGIEGO STOPNIA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ DLA KWALIFIKACJI NA POZIOMACH 6-8 POLSKIEJ RAMY KWALIFIKACJI W ODNIESIENIU DO DYSCYPLIN NAUKOWYCH I EFEKTÓW KIERUNKOWYCH

Symbole efektów dyscyplinowych:

S/NZJA_P7S_UW+, S/EFA_P7S_WG+++, S/NZJA_P7S_WG+++, S/EFA_P7S_UW+, S/NZJA_P7S_KK+, S/NZJA_P7S_WK+

Symbole efektów kierunkowych:

KP7_WG1++, KP7_WK6+, KP7_UW2+, KP7_WG5+, KP7_KK1+

EFEKTY UCZENIA SIĘ:

Wiedza:

W1 –Poznanie podstaw metod inwestycji na rynku finansowym oraz wybranych klas aktywów.

W2 –Opanowanie wiedzy dotyczącej najważniejszych zagadnień z zakresu zarządzania inwestycjami finansowymi

Umiejętności:

U1 –Nabycie umiejętności w zakresie doboru instrumentów inwestycyjnych w kontekście zysku i ryzyka

Kompetencje społeczne:

K1 –Student potrafi rozwijać i pogłębiać zdobytą wiedzę i umiejętności w zakresie inwestycji

Akty prawne określające efekty uczenia się:

684/2020

Dyscypliny: ekonomia i finanse, nauki o zarządzaniu i jakości

Status przedmiotu: Fakultatywny

Grupa przedmiotów: C - przedmioty specjalnościowe/związane z zakresem kształcenia

Kod: ISCED

Kierunek studiów: Zarządzanie

Zakres kształcenia: Logistyka, Rachunkowość i zarządzanie finansami, Zarządzanie inwestycjami i nieruchomościami, Zarządzanie małym i średnim przedsiębiorstwem

Profil kształcenia: Ogólnoakademicki

Forma studiów: Stacjonarne

Poziom studiów: Drugiego stopnia

Rok/sesemstr: 1/2, 2/3

Rodzaj zajęć: Wykład, Ćwiczenia

Liczba godzin w semestrze: Wykład: 15.00, Ćwiczenia: 15.00

Język wykładowy: polski

Przedmioty wprowadzające: Finanse, Rynek kapitałowy

Wymagania wstępne: Znajomość zasad funkcjonowania rynku finansowego oraz papierów wartościowych

Nazwa jednostki org. realizującej

przedmiot: Instytut Ekonomii i Finansów

Osoba odpowiedzialna za realizację

przedmiotu: dr Karol Wojtowicz

e-mail: karolw@uwm.edu.pl

Uwagi dodatkowe: Ćwiczenia

realizowane są w formie warsztatów z wykorzystaniem rzeczywistych danych dot. indeksów giełdowych oraz papierów wartościowych pochodzących z bazy EIKON Refinitive (Thomson Reuters).

FORMY I METODY DYDAKTYCZNE:

Wykład(W1, W2, U1, K1):Wykład wspomagany audiowizualnie, case study

Ćwiczenia(U1, K1):Analiza wybranych zagadnień, Studium przypadku, Warsztaty z wykorzystaniem danych rynkowych pochodzących z bazy Eikon Refinitive (Thomson Reuters).

FORMA I WARUNKI WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ:

Ćwiczenia: Kolokwium pisemne - Kolokwium pisemne - test wyboru oraz zadania dotyczące problematyki przedmiotu. Warunkiem zaliczenia jest uzyskanie min. 60%. (U1, K1);

Wykład: Egzamin pisemny - Egzamin pisemny w formie testu wielokrotnego wyboru oraz pytań otwartych. Warunkiem zaliczenia jest uzyskanie min. 60%. (W1, W2, U1, K1);

LITERATURA PODSTAWOWA:

1. Borowski K., tytuł: Metody inwestowania na rynkach finansowych, wyd. Difin, rok 2018
2. Jajuga K., Jajuga T., tytuł: Inwestycje, wyd. PWN, rok 2015

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

1. Zareba A., tytuł: Giełda. Podstawy inwestowania, wyd. Onepress, rok 2014
2. Haugen R., tytuł: Teoria nowoczesnego inwestowania, wyd. WIG Press, rok 1996

Szczegółowy opis przyznanej punktacji ECTS – część B

12S2O-INRF

ECTS: 2.0

CYKL: 2021Z

Inwestycje na rynku finansowym

Na przyznaną liczbę punktów ECTS składają się:

1. Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim:

- udział w: Wykład	15.0 h
- udział w: Ćwiczenia	15.0 h
- konsultacje	2.0 h
OGÓŁEM: 32.0h	

2. Samodzielna praca studenta:

przygotowanie do zaliczenia	6.00 h
przygotowanie do zajęć	6.00 h
przeprowadzenie analiz wybranych inwestycji - studium przypadku	6.00 h

OGÓŁEM: 18.0h

godziny kontaktowe + samodzielna praca studenta OGÓŁEM: 50.0h

1 punkt ECTS = 25-30 h pracy przeciętnego studenta,
liczba punktów ECTS= 50.0 h : 25.0h/ECTS = 2.00 ECTS

Średnio: 2.0 ECTS

- w tym liczba punktów ECTS za godziny kontaktowe z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego	1.28 punktów ECTS
- w tym liczba punktów ECTS za godziny realizowane w formie samodzielnej pracy studenta	0.72 punktów ECTS