

WYDZIAŁ INFORMATYKI I ZARZĄDZANIA**KARTA PRZEDMIOTU****Nazwa w języku polskim Rynek kapitałowy II****Nazwa w języku angielskim Capital market II****Kierunek studiów (jeśli dotyczy): Zarządzanie****Specjalność (jeśli dotyczy): Zarządzanie finansami (ZF)****Stopień studiów i forma: II stopień, stacjonarna****Rodzaj przedmiotu: obowiązkowy****Kod przedmiotu FBZ1197****Grupa kursów NIE**

	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium
Liczba godzin zajęć zorganizowanych w Uczelni (ZZU)	15		15		
Liczba godzin całkowitego nakładu pracy studenta (CNPS)	30		30		
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)	0,5		1		

*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.

Z zakresu kompetencji społecznych:

PEK_K01 ma świadomość znaczenia rachunkowości międzynarodowej w praktyce gospodarczej

TREŚCI PROGRAMOWE

Forma zajęć - wykład		Liczba godzin
Wy1	Przedstawienie wymagań i regulaminu zajęć. Przypomnienie podstawowych pojęć związanych z rynkiem finansowym	1
Wy2	Symulacja Monte Carlo w arkuszu kalkulacyjnym	2
Wy3	Konstrukcja modeli wyceny i analizy obligacji – przykłady zastosowania metod analitycznych	2
Wy4	Konstrukcja modeli wyceny akcji i analizy ryzyka inwestowania w akcje – przykłady zastosowania metod analitycznych	2
Wy5	Konstrukcja modeli wyceny akcji i analizy ryzyka inwestowania w akcje – przykłady zastosowania metod symulacyjnych	2
Wy6	Konstrukcja modeli wyceny i analizy instrumentów pochodnych – przykłady zastosowania metod analitycznych	2
Wy7	Konstrukcja modeli wyceny i analizy instrumentów pochodnych – przykłady zastosowania metod symulacyjnych	2
Wy8	Kolokwium zaliczeniowe	2
Suma godzin		15

Forma zajęć - ćwiczenia		Liczba godzin
Ćw1		
Ćw2		
Ćw3		
Suma godzin		

Forma zajęć - laboratorium		Liczba godzin
La1	Przedstawienie wymagań i regulaminu zajęć	1
La2	Model analityczny wyceny obligacji	2
La3	Model symulacyjny wyceny akcji	2
La4	Wykorzystanie metod symulacyjnych do budowy portfela z uwzględnieniem instrumentów ryzykownych i pozbawionych ryzyka	2
La5	Model analityczny wyceny opcji	2
La6	Model symulacyjny wyceny opcji	2

La7	Modele symulacyjne i analityczne wyceny innych instrumentów finansowych	2
La8	Zaliczenie	2
	Suma godzin	15

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
F5	PEK_U01 PEK_U02	Zadanie cząstkowe nr 5
P: kolokwium zaliczeniowe PEK_W01		

LITERATURA PODSTAWOWA I UZUPEŁNIAJĄCA

LITERATURA PODSTAWOWA:

- [1] Jajuga K., Jajuga T., *Inwestycje. Instrumenty finansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2001
- [2] Holden C.W., *Excel modeling in investments*, Pearson Education, 2012
- [3] Wilimowska Z., *Metodyka budowy efektywnego portfela projektów inwestycyjnych*, Oficyna Wydawnicza Politechniki Wrocławskiej, Wrocław 1997.

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

- [1] Mielczarek B., *Modelowanie symulacyjne w zarządzaniu. Symulacja dyskretna*. Oficyna Wydawnicza PWr Wrocław 2009

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	WY2- WY7	N1
PEK_U01 (umiejętności)	S2_IZF_U05	C2, C3	LA2- LA7	N1, N2
PEK_U02	S2_IZF_U06	C2, C3	LA2-LA7	N1, N2
PEK_K01 (kompetencje)	K2_ZARZ_K01	C1+C1	wszystkie	N1-N2

** - wpisać symbole kierunkowych/specjalnościowych efektów kształcenia

*** - z tabeli powyżej