

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Inwestycje finansowe, PG_00155593						
Kierunek studiów	Zarządzanie (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2024/2025		
Poziom kształcenia	II stopnia		Grupa zajęć		Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	1		Język wykładowy		polski		
Semestr studiów	1		Liczba punktów ECTS		3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania -> Katedra Inwestycji i Nieruchomości						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr Krzysztof Kowalke				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	15.0	0.0	0.0	0.0	30
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów		Udział w konsultacjach		Praca własna studenta	RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	30		14.0		31.0	75
Cel przedmiotu	Zrozumienie procesu alokacji kapitału w aktywa finansowe, zasad analizy efektywności i ryzyka inwestycji finansowych, wyceny instrumentów finansowych.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Effekt kierunkowy	Effekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[ZARZMU2_K01] Ma świadomość deprecjacji wiedzy w czasie i rozumie potrzebę uczenia się przez całe życie i pogłębiania wiedzy zarówno w trybie akademickim jak również pozaakademickim. Potrafi inspirować i organizować proces uczenia się innych osób.	Ma świadomość deprecjacji wiedzy o rynkach finansowych w czasie i rozumie potrzebę uczenia się przez całe życie i pogłębiania wiedzy zarówno w trybie akademickim jak również pozaakademickim.	[SK4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[ZARZMU2_W13] Zna w sposób pogłębiony szereg zaawansowanych metod, technik analiz menedżerskich wspomagających proces podejmowania decyzji gospodarczych, a także zna źródła pozyskiwania danych i informacji z zakresu poszczególnych dziedzin nauk społecznych, w szczególności nauk o zarządzaniu i jakości.	Zna w sposób pogłębiony szereg różnych metod, technik analiz menedżerskich wspomagających proces podejmowania decyzji inwestycyjnej na rynku finansowym (w szczególności analizę fundamentalną, modele wyceny: bonów skarbowych, certyfikatów depozytowych, akcji, obligacji), a także zna źródła pozyskiwania danych i informacji z zakresu poszczególnych dziedzin nauk społecznych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja
	[ZARZMU2_K04] Ma świadomość konieczności rozstrzygania dylematów związanych z wykonywaniem zawodu i wypełnianiem zobowiązań społecznych. Prawidłowo je identyfikuje.	Prawidłowo identyfikuje i rozstrzyga dylematy związane z wykonywaniem zawodu związanego z działalnością rynków finansowych	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja [SK4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SK5] realizacja zadania problemowego
	[ZARZMU2_W01] Ma rozszerzoną wiedzę w zakresie nauk społecznych ze szczególnym uwzględnieniem dyscypliny nauk o zarządzaniu i jakością oraz rozumie ich relację z innymi naukami społecznymi.	Ma rozszerzoną wiedzę w zakresie nauk ekonomicznych ze szczególnym uwzględnieniem zarządzania inwestycjami finansowymi oraz rozumie ich relację z innymi naukami społecznymi.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja [SW5] realizacja zadania problemowego
	[ZARZMU2_U04] Potrafi w sposób kreatywny zastosować zdobytą wiedzę z zakresu nauk o zarządzaniu i jakości w praktyce zawodowej.	Potrafi zastosować zdobytą wiedzę z obszaru inwestycji finansowych w praktyce zawodowej.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/diskusja [SU5] realizacja zadania problemowego
	[ZARZMU2_U05] Potrafi poprawnie wybrać oraz zastosować zaawansowane, złożone metody i narzędzia stosowane w naukach o zarządzaniu i jakości.	Potrafi poprawnie wybrać i zastosować zaawansowane metody i narzędzia stosowane w inwestycjach finansowych.	[SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SU5] realizacja zadania problemowego

Treści przedmiotu	1. Instrumenty finansowe rynku pieniężnego 2. Obligacje zerokuponowe wycena i szacowanie stopy rentowności 3. Wycena obligacji kuponowych 4. Stopa zwrotu z obligacji kuponowych 5. Czas trwania oraz zmodyfikowany czas trwania obligacji 6. Wypukłość obligacji 7. Wycena akcji metodą majątkową oraz wskaźnikową 8. Wycena akcji przy wykorzystaniu dywidendowego modelu wyceny 9. Model DCF i jego wykorzystanie przy inwestowaniu w akcje 10. Analiza portfela papierów wartościowych 11. Ryzyko portfela papierów wartościowych 12. Charakterystyka instrumentów pochodnych 13. Charakterystyka rynku walutowego 14. Teoria Efektywności Rynku Kapitałowego		
Wymagania wstępne i dodatkowe	znajomość matematyki finansowej i podstaw funkcjonowania rynku finansowego		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Kolokwium zaliczeniowe z ćwiczeń	51.0%	40.0%
	Test zaliczeniowy z wykładu	51.0%	60.0%

Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	Jajuga K., Jajuga T.: Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN, Warszawa 2006. Fabozzi F.J.: Rynki obligacji. Analiza i strategię, WID-Press, Warszawa 2000. Dębski W.: Rynek finansowy i jego mechanizmy, PWN, Warszawa 2010. Wycena i zarządzanie wartością firmy. Praca zbiorowa pod redakcją naukową A.Szablewskiego, R.Tuzimka, Poltext, Warszawa 2004. Zarządzanie inwestycjami i nieruchomościami. Wybrane problemy. Praca zbiorowa pod redakcją naukową M. Rymarzak, Fundacja Rozwoju Uniwersytetu Gdańskiego, Gdańsk 2011. Reilly F.K., Brown K.C.: Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, PWE, Warszawa 2001.
	Uzupełniająca lista lektur	Szczepankowski P.: Wycena i zarządzanie wartością przedsiębiorstwa, PWN, Warszawa 2007. Cornel B.: Wycena spółek. Metody i narzędzia efektywnej wyceny, Liber, Warszawa 1999. Hull J.: Kontrakty terminowe i opcje. WIG-Press; Warszawa 1997; A. Sopoćko: Rynkowe instrumenty finansowe, PWN, Warszawa 2005. Ostrowska E.: Rynek kapitałowy, Polskie wydawnictwo ekonomiczne, Warszawa 2007. Mayo H.B.: Wstęp do inwestowania, K. E. LIBER, Warszawa 1997. Inwestycje rzeczowe i kapitałowe. Praca zbiorowa pod redakcją naukową J. Różańskiego, Difin, Warszawa 2006. Brigham E. F., J. F. Houston: Podstawy zarządzania finansami. Tom 1. Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2005.
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy	

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.