

KARTA PRZEDMIOTU

Analityka Gospodarcza

Nazwa przedmiotu	Analiza Rynków Finansowych i Towarowych			
Język prowadzenia przedmiotu	polski			
Kod/Specjalność				
Kategoria przedmiotu	Kierunkowe			
Profil studiów	Ogólnoakademicki			
Poziom PRK	6			
Rok studiów/semestr	3/6			
Forma zajęć/liczba godzin		Wykłady	Inne	
	Stacjonarne:	15	15	
	Niestacjonarne:	9	9	
Dyscypliny	Nazwa	Liczba punktów ECTS		
	Ekonomia i Finanse	3		
Wykładowca odpowiedzialny za przedmiot na kierunku	Maciej Kostrzewski, dr (Katedra Ekonometrii i Badań Operacyjnych)			
Cele przedmiotu	Kod	Opis		
	C1	Zapoznanie z mechanizmem funkcjonowania rynków finansowych i towarowych. Przedstawienie podstawowych instrumentów handlowanych na giełdach. Zapoznanie z podstawowymi metodami wyceny instrumentów pochodnych oraz przedstawienie wybranych strategii inwestycyjnych.		
	C2	Wykształcenie umiejętności budowy strategii arbitrażowych i replikujących. Umiejętność wyboru odpowiedniej strategii inwestycyjnej w zależności od prognoz rynkowych i postawionego celu. Umiejętność wyceny wybranych instrumentów pochodnych oraz interpretacji zjawisk zachodzących na rynkach finansowych i towarowych.		
	C3	Uświadomienie potrzeby uzupełniania nabytej wiedzy i umiejętności, a także wskazanie kierunków i możliwości pogłębiania zdobytej wiedzy i umiejętności.		
Realizowane efekty uczenia się	Kod	Kat.	Opis	Odniesienie do efektów kierunkowych
	E1	P_W	Posiada podstawową wiedzę na temat funkcjonowania wybranych rynków finansowych i rynków towarowych. Zna podstawowe instrumenty handlowane na giełdach oraz modele ich wyceny. Posiada wiedzę na temat konstrukcji strategii inwestycyjnych.	AG_W01 AG_W05
	E2	P_W	Zna metody estymacji parametrów wybranych modeli wyceny instrumentów pochodnych. Zna typowe własności finansowych i towarowych szeregów czasowych	AG_W03
	E3	P_U	Posiada umiejętność wyboru oraz konstrukcji strategii inwestycyjnej w zależności od sytuacji, prognoz rynkowych i postawionego celu.	AG_U02 AG_U05 AG_U08 AG_U09
	E4	P_U	Potrafi estymować i zastosować wybrane modele wyceny instrumentów pochodnych. Potrafi interpretować uzyskane wyniki oraz oceniać przydatność zastosowanego modelu na danych rzeczywistych	AG_U02 AG_U05 AG_U08 AG_U09 AG_U10
	E5	P_K	Ma świadomość potrzeby uzupełniania nabytej wiedzy i umiejętności oraz potrafi tę potrzebę zaspokajać.	AG_K01 AG_K02 AG_K04
Sposoby weryfikacji efektów uczenia się	Wybrane ze sposobów: (F1) egzamin pisemny, (F2) egzamin ustny, (F3) kolokwium, (F4) praca pisemna, (F5) test wyboru, (F6) projekt grupowy, (F7) projekt indywidualny, (F8) prezentacja			

Treści przedmiotu	Kod	Opis	Liczba godzin stacjonarne	Liczba godzin niestacjonarne
	W1	Charakterystyka rynków finansowych i towarowych. Definicje instrumentów pochodnych. Podstawy inżynierii finansowej: arbitraż, strategia replikująca. Metody i modele wyceny kontraktów terminowych.	6	5
	W2	Statystyczne własności cen instrumentów notowanych na giełdach papierów wartościowych i towarowych.	2	1
	W3	Prezentacja metod estymacji parametrów modeli wyceny kontraktów terminowych	2	1
	W4	Zastosowania inżynierii finansowej	5	2
	L1	Konstrukcje wybranych strategii inwestycyjnych. Modele wyceny wybranych kontraktów terminowych.	6	4
	L2	Analiza statystycznych własności cen instrumentów notowanych na giełdach papierów wartościowych i towarowych	4	2
	L3	Przykłady zastosowań inżynierii finansowej.	5	3
		suma	30	18
Metody prowadzenia zajęć	(N1) wykład audytoryjny, (N2) ćwiczenia przedmiotowe, (N3) dyskusja, (N4) symulacja, (N5) analiza przypadku, (N6) nauczanie problemowe, (N7) ćwiczenia laboratoryjne			
Nakład pracy studenta (liczba godzin kontaktowych, pracy on-line i pracy samodzielnej)	Rodzaj aktywności		Liczba godzin	
			stacjonarne	Nie stacjonarne
	Udział w zajęciach dydaktycznych w bezpośrednim kontakcie z prowadzącym		30	18
	Udział w konsultacjach		10	7
	Udział w kolokwiach/egzaminie		5	3
	Praca własna studenta		30	47
	E-learning		---	---
	Inne		---	---
	Suma godzin		75	75
Liczba punktów ECTS		3		

<i>Macierz realizacji przedmiotu</i>	<i>Przedmiot. efekt uczenia się</i>	<i>Odniesienie do efektów kierunkowych</i>	<i>Cele przedmiotu</i>	<i>Treści przedmiotu</i>	<i>Metody/narzędzia dydaktyczne</i>	<i>Sposoby weryfikacji efektu</i>
	E1	AG_W01, AG_W05	C1, C2	W1,W3,L1	N1,N2,N3,N4,N7	F1,F2,F4,F5
	E2	AG_W03	C1, C2	W2, W3, L2,L3	N1, N2,N3,N7	F1,F2,F3,F4,F5, F6,F7,F8
	E3	AG_U02, AG_U05, AG_U08, AG_U09	C2	W1,W4	N1, N3, N4, N5, N6, N7	F1, F2, F3, F4, F5, F6, F7, F8
	E4	AG_U02, AG_U05, AG_U08, AG_U09	C2	W1, W2, W3, W4, L1, L2, L3	N1,N2,N3, N7	F1, F2, F3, F4,F5, F6, F7, F8
	E5	AG_K01, AG_K02, AG_K04	C3	W4, L3	N1, N2, N3,N5, N6, N7	F1, F2, F4,F6, F7
<i>Literatura podstawowa</i>	1. Jajuga Krzysztof, Jajuga Teresa (2006), Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN, Warszawa 2006 2. Weron Rafał (2006), Modeling and Forecasting Electricity Loads and Prices: A Statistical Approach, Wiley, Chichester					
<i>Literatura uzupełniająca</i>	1. Capiński Marek, Zastawniak Tomasz (2003), Mathematics for Finance. An Introduction to Financial Engineering, Springer undergraduate mathematics series 2. Hull John (1998), Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie, WIG-Press, Warszawa					
<i>Forma i warunki zaliczenia przedmiotu</i>	Ocena końcowa z przedmiotu jest średnią ważoną: średniej z ocen bieżących oraz wszystkich ocen z egzaminu – pod warunkiem, że średnia z ocen bieżących oraz jedna z ocen z egzaminu są pozytywne. Szczegółowe informacje dotyczące sposobu oceniania zostają podane studentom w trakcie zajęć.					
<i>Osoby prowadzące przedmiot</i>	Kostrzewski Maciej, dr (Katedra Ekonometrii i Badań Operacyjnych)					
<i>Informacje dodatkowe</i>	---					