



11120-13-C_F

RYNEK PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH

ECTS: 7

STOCK MARKET

TREŚCI WYKŁADÓW

Rodzaje, funkcje i charakterystyka papierów wartościowych. Struktura, uczestnicy i działanie rynku finansowego. Działanie Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie. Instrumenty pochodne: opcje, kontrakty terminowe. Krótka sprzedaż. Metody analizy i prognozowanie rynków papierów wartościowych. Wskaźniki giełdowe, indeksy giełdowe, wykresy. Analiza techniczna rynków: teoria Dow, analiza wykresów cenowych, zastosowania prognostyczne ciągu Fibonacciego. Analiza fundamentalna. Metody wyceny papierów wartościowych: przepływów finansowych, porównawcza. Wycena obligacji. Wybrane modele matematyczne stosowane do rynków kapitałowych. Model Sharpe'a, Model równowagi rynku kapitałowego CAPM. Model Blacka-Scholesa. Wprowadzenie do teorii portfela papierów wartościowych. Ryzyko, stopa zwrotu, korelacja stóp zwrotu. Metody wyboru portfela.

TREŚCI ĆWICZEŃ

Obliczanie wartości obligacji, praw poboru i innych wielkości związanych z obrotem papierami wartościowymi. Ocena prospektów emisyjnych. Analiza wykresów cenowych. Analiza komentarzy giełdowych oraz innych publikacji na tematy związane z rynkami finansowymi. Używanie współczynników Fibonacciego do prognozowania. Obliczanie ceny opcji oraz poziomów zabezpieczeń pozycji w akcjach przy pomocy modelu Blacka-Scholesa. Obliczanie wskaźników w analizie portfelowej. Tworzenie optymalnego portfela akcji.

CEL KSZTAŁCENIA

Przekazanie wiedzy na temat funkcjonowania rynków finansowych oraz Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie. Rozwinięcie umiejętności oceny i analizy prospektów emisyjnych, wykresów cenowych, komentarzy giełdowych. Rozwinięcie umiejętności pracy w grupie.

OPIS EFEKTÓW KSZTAŁCENIA PRZEDMIOTU W ODNIESIENIU DO OBSZAROWYCH I KIERUNKOWYCH EFEKTÓW KSZTAŁCENIA

Symbole efektów obszarowych X1A_W02, X1A_W03, X1A_W04; X1A_U01, X1A_U02, X1A_U03, X1A_U04, X1A_U05, X1A_U07; X1A_K01, X1A_K06, X1A_K07

Symbole efektów kierunkowych K_W03, K_W04; K_U01, K_U11, K_U25, K_U29, K_U30; K_K01, K_K06

EFEKTY KSZTAŁCENIA

Wiedza

Znajomość podstawowych mechanizmów funkcjonowania rynków papierów wartościowych.

Umiejętności

Umiejętność analizy i oceny publikacji związanych z rynkami finansowymi.

Kompetencje społeczne

Rozumienie potrzeby dokształcania się. Świadomość w podejmowaniu decyzji finansowych.

LITERATURA PODSTAWOWA

1) K.Jajuga, T.Jajuga, 2006r., "Inwestycje", wyd. PWN, 2) A.Weron, R.Weron, 1998r., "Inżynieria finansowa", wyd. WNT, 3) W.Bień, 2008r., "Rynek papierów wartościowych", wyd. Difin.

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA

1) E.J.Elton, M.J.Gruber, 1998r., "Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych", wyd. WIG Press, 2) J.Hull, 1997r., "Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie", wyd. WIG Press, 3) M.Tyran, 2004r., "Wskaźniki finansowe", wyd. Kraków.

Przedmiot/moduł:

RYNEK PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH

Obszar kształcenia: nauki ścisłe

Status przedmiotu: Fakultatywny

Grupa przedmiotów: C_F-przedmiot specjalnościowy do wyboru

Kod ECTS: 11120-13-C_F

Kierunek studiów: Matematyka

Specjalność: Matematyka stosowana

Profil kształcenia: Ogólnoakademicki

Forma studiów: Stacjonarne

Poziom studiów/Forma kształcenia: Studia pierwszego stopnia

Rok/semestr: III / 6

Rodzaje zajęć: wykłady/ćwiczenia

Liczba godzin w semestrze/tygodniu:

wykłady: 30/2

ćwiczenia: 30/2

Formy i metody dydaktyczne

wykłady: informacyjny, konwersatoryjny

ćwiczenia: audytoryjne, rozwiązywanie zadań, dyskusja

Forma i warunki zaliczenia: Egzamin/zaliczenie z oceną na podstawie kolokwium i pracy na lekcji, egzamin pisemny

Liczba punktów ECTS: 7

Język wykładowy: polski

Przedmioty wprowadzające: Rachunek finansowy

Wymagania wstępne: Analiza matematyczna

Nazwa jednostki organizacyjnej realizującej

przedmiot:

Katedra Matematyki Stosowanej

adres: ul. Słoneczna 54, 10-710 Olsztyn

tel. 524 60 46/524 60 07

Osoba odpowiedzialna za realizację przedmiotu:

dr Irena Morocka-Tralle

Szczegółowy opis przyznanej punktacji ECTS - część B

RYNEK PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH

ECTS: 7

STOCK MARKET

Na przyznaną liczbę punktów ECTS składają się :

1. Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim:

- wykłady	30,0 godz.
- ćwiczenia	30,0 godz.
- Konsultacje	7,0 godz.
- Egzamin i omówienie wyników	8,0 godz.
	75,0 godz.

2. Samodzielna praca studenta:

- Przygotowanie do wykładów, ćwiczeń, kolokwium i egzaminu	100,0 godz.
	100,0 godz.
godziny kontaktowe + samodzielna praca studenta OGÓŁEM:	175,0 godz.

1 punkt ECTS = 25,00 godz. pracy przeciętnego studenta,

liczba punktów ECTS = 175,00 godz.: 25,00 godz./ECTS = **7,00 ECTS**

w zaokrągleniu: **7 ECTS**

- w tym liczba punktów ECTS za godziny kontaktowe z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego - **3,00** punktów ECTS,

- w tym liczba punktów ECTS za godziny realizowane w formie samodzielnej pracy studenta - **4,00** punktów ECTS.