

Nazwa przedmiotu	Finanse
Kod przedmiotu	<i>do wypełnienia przez dziekanat</i>
Profil studiów	ogólnoakademicki
Stopień studiów	pierwszy
Kierunek studiów	Ekonometria i Data Science
Specjalność (jeśli dotyczy)	
Forma studiów	studia stacjonarne oraz niestacjonarne wieczorowe
Rok studiów	II
Semestr	zimowy
Liczba godzin	60
Forma/typ zajęć	wykład (30h) + ćwiczenia (30h)
Punkty ECTS	5
Rodzaj przedmiotu (przedmiot obowiązkowy / kierunkowy do wyboru / fakultatywny / seminarium)	obowiązkowy
Sposób realizacji przedmiotu (stacjonarny / zdalny / kurs internetowy / kurs realizowany metodą blended learning)	stacjonarny
Język wykładowy	polski
Wymagania formalne	brak
Założenia wstępne	Zakłada się, że student zna podstawowe zagadnienia z makroekonomii i mikroekonomii.
Skrócony opis przedmiotu	Kurs omawia podstawowe zagadnienia z zakresu finansów łącząc teorię z przykładowymi problemami praktycznymi. Omawiane są najważniejsze zagadnienia matematyki finansowej oraz narzędzia oceny zyskowności inwestycji, które dają podstawę do analizy głównych instrumentów natychmiastowego oraz terminowego rynku pieniężnego i kapitałowego. Kurs obejmuje także najważniejsze aspekty budowania portfeli inwestycyjnych na gruncie różnych modeli rynku kapitałowego.
Treści kształcenia dla przedmiotu	Przedmiot obejmuje sześć obszarów tematycznych, które składają się na zrozumienie zasad funkcjonowania nowoczesnego systemu finansowego, ze szczególnym uwzględnieniem instrumentów z rynku pieniężnego, kapitałowego i terminowego. Celem wykładu jest przybliżenie roli systemu finansowego w gospodarce w ujęciu teoretycznym i praktycznym, omówienie działania i wyceny instrumentów finansowych. Na wykładzie poruszone zostaną zagadnienia związane z oceną inwestycji oraz analizą finansową przedsiębiorstwa. Celem ćwiczeń jest ugruntowanie wiedzy poznanej podczas wykładów, ze szczególnym naciskiem na analizę przykładów z poszczególnych obszarów tematycznych a także rozwiązywanie zadań z matematyki finansowej. W kolejnych blokach omawiane są następujące treści: • Rola systemu finansowego w gospodarce. Zagadnienia: definicja finansów i systemu finansowego, powiązanie systemu finansowego z

	różnymi podmiotami (prywatnymi i publicznymi), w tym polityka fiskalna i monetarna, struktura systemu finansowego, w tym rynek pieniężny, kapitałowy, walutowy, terminowy (instrumenty, uczestnicy, instytucje). Szczegółowo - rynek terminowy: kontrakty typu futures, forward, opcje – mechanizm działania, proste strategie. • Rynek pieniężny: bony skarbowe, certyfikaty depozytowe, rynek międzybankowy. Zagadnienia: definicje i rodzaje, wycena. • Rynek kapitałowy: akcje. Zagadnienia: definicje i rodzaje, wycena, analiza fundamentalna i techniczna. • Rynek kapitałowy: obligacje. Zagadnienia: definicje i rodzaje, wycena, charakterystyki, podstawowe strategie. • Analiza portfelowa: ryzyko, stopa zwrotu, portfele: jedno-, dwu-, trzy-wieloskładnikowe, krótka sprzedaż, Model klasyczny (Markowitz), Model Sharpa, Model CAPM. • Przedsiębiorstwo jako uczestnik rynku kapitałowego. Zagadnienia: decyzje inwestycyjne, analiza ekonomiczno-finansowa: analiza sprawozdań finansowych, analiza wskaźnikowa.
Przedmiotowe efekty uczenia się	Po ukończeniu przedmiotu, student: W ZAKRESIE WIEDZY: • zna i rozumie zasady funkcjonowania systemu finansowego, instrumentów finansowych rynku pieniężnego, kapitałowego i terminowego • zna i rozumie zasady budowy portfela i oceny inwestycji • zna i rozumie zasady analizy finansowej przedsiębiorstwa W ZAKRESIE UMIEJĘTNOŚCI: • potrafi obliczać wartość pieniądza w czasie • potrafi stosować i wyceniać instrumenty z rynku pieniężnego, kapitałowego i terminowego • potrafi konstruować portfel inwestycyjny na podstawie teorii rynku kapitałowego • potrafi ocenić przedsiębiorstwo na podstawie jego danych finansowych W ZAKRESIE KOMPETENCJI: • wykazuje świadomość konieczności stałego poszerzania swojej wiedzy, jej aktualizowania i weryfikowania. • jest gotów do własnej analizy zjawisk finansowych
Powiązanie efektów przedmiotowych z efektami kierunkowymi/specjalnościowym i (oznaczonymi kodami z programu nauczania)	Ekonometria i Data Science: K_W01, K_W02, K_W03, K_W05, K_U01, K_U02, K_K01
Nakład pracy studenta	Szacunkowy nakład pracy studenta: 5ECTS x 25h = 125h (K) - godziny kontaktowe (S) - godziny pracy samodzielnej wykład (zajęcia): 30h (K) 0h (S) ćwiczenia (zajęcia): 30h (K) 0h (S) egzamin: 3h (K) 0h (S) konsultacje: 12h (K) 0h (S) przygotowanie do ćwiczeń: 0h (K) 15h (S)

	przygotowanie do wykładów: 0h (K) 5h (S) przygotowanie do kolokwium: 0h (K) 15h (S) przygotowanie do egzaminu: 0h (K) 15h (S) Razem: 75h (K) + 50h (S) = 125h
Metody i kryteria oceniania	Uzyskanie zaliczenia przedmiotu wymaga: 1. Na ocenę końcową z ćwiczeń składają się wyniki z prac domowych, łącznie 10 punktów z wagą 10% oraz kolokwium za 30 punktów z wagą 90% do oceny końcowej. Studenci mogą również zdobyć 10 punktów dodatkowych z wagą 10% do oceny końcowej. Aby uzyskać zaliczenie studenci muszą zdobyć co najmniej połowę punktów z kolokwium oraz przekroczyć próg 50% oceny końcowej. Jeżeli studenci opuszczą więcej niż 5 zajęć, wtedy zostają nieklasyfikowani z ćwiczeń w obydwu terminach. 2. Egzamin pisemny: rozwiązanie 3 zadań z 4 do wyboru. Na końcową ocenę z wykładu składają się oceny z egzaminu (80%) oraz z ćwiczeń (20%). 3. Skala ocen: [0%-50%) – ndst [50%-60%) – dst [60%-70%) – dst + [70%-80%) – db [80%-90%) – db+ [90%-100%) – bdb.
Literatura	Literatura obowiązkowa: W. Dębski, „Rynek finansowy i jego mechanizmy”, PWN 2024 Literatura uzupełniająca: D. Blake, Financial Market Analysis, John Wiley and Sons, 2000 F. Fabozzi, „Rynki obligacji. Analiza i strategię”, WIG Press 2000 J.Hull, Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie, WIG Press 1998 K. Jajuga, T. Jajuga, Inwestycje. Instrumenty finansowe. Aktywa niefinansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa. PWN 2015 J. Murphy, „Analiza techniczna rynków finansowych”, Księgarnia maklerska 2017
Metody dydaktyczne	W ramach wykładu wykorzystywane są następujące metody dydaktyczne: - prezentacja multimedialna - metody problemowe (case study, dyskusja) W ramach ćwiczeń wykorzystywane są następujące metody dydaktyczne: - ćwiczenia rachunkowe i analityczne - analiza danych w programach komputerowych
Oprogramowanie	MS Excel