



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	MODELE RYNKU KAPITAŁOWEGO, PG_00049941						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2021 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu		2022/2023			
Poziom kształcenia	II stopnia	Grupa zajęć		Grupa zajęć fakultatywnych Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki			
Forma studiów	stacjonarne	Sposób realizacji		na uczelni			
Rok studiów	2	Język wykładowy		polski			
Semestr studiów	3	Liczba punktów ECTS		3.0			
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia		zaliczenie			
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr Błażej Kochoński				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu		dr Błażej Kochoński				
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	30.0	0.0	0.0	0.0	45
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
	Modele rynku kapitałowego 2022/2023 - Moodle ID: 24348 <a href="https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=24348">https://enauczanie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=24348</a>						
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	45	4.0	26.0	75		
Cel przedmiotu	Nabycie wiedzy dotyczącej modeli rynku kapitałowego oraz umiejętności wykorzystania tych informacji w rozwiązywaniu problemów zawodowych.						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K7_W12] ma szeroką wiedzę w zakresie ewolucji struktur, instytucji i więzi społeczno-gospodarczych		Student opisuje zmiany zachodzące na rynkach kapitałowych i w ich otoczeniu.		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej [SW3] Ocena wiedzy zawartej w opracowaniu tekstowym i projektowym		
	[K7_U08] posiada umiejętność implementacji metod analitycznych do samodzielnego proponowania rozwiązań problemów gospodarczych i weryfikacji ich skuteczności		Student wykorzystuje poznane modele rynku kapitałowego do analizy rynku kapitałowego w Polsce i za granicą wraz z oceną ich skuteczności.		[SU1] Ocena realizacji zadania [SU2] Ocena umiejętności analizy informacji [SU4] Ocena umiejętności korzystania z metod i narzędzi		

Treści przedmiotu	<p>Obliczanie stóp zwrotu.</p> <p>Statystyka opisowa i zmienne losowe w modelowaniu rynku kapitałowego.</p> <p>Analiza średniej-wariancji.</p> <p>Model CAPM.</p> <p>Modele wieloczynnikowe - teoria wyceny arbitrażowej.</p> <p>Wycena opcji.</p> <p>Strategia log-optymalna.</p>														
Wymagania wstępne i dodatkowe	Wiedza z zakresu finansów, zwłaszcza rynków finansowych.														
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	<table border="1" data-bbox="451 707 1487 864"> <thead> <tr> <th data-bbox="451 707 794 734">Sposób oceniania (składowe)</th> <th data-bbox="794 707 1145 734">Próg zaliczeniowy</th> <th data-bbox="1145 707 1487 734">Składowa oceny końcowej</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="451 734 794 768">sprawdzian teoretyczny</td> <td data-bbox="794 734 1145 768">60.0%</td> <td data-bbox="1145 734 1487 768">10.0%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="451 768 794 824">sprawdziany z zadań obliczeniowych</td> <td data-bbox="794 768 1145 824">60.0%</td> <td data-bbox="1145 768 1487 824">50.0%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="451 824 794 864">projekt</td> <td data-bbox="794 824 1145 864">60.0%</td> <td data-bbox="1145 824 1487 864">40.0%</td> </tr> </tbody> </table>			Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej	sprawdzian teoretyczny	60.0%	10.0%	sprawdziany z zadań obliczeniowych	60.0%	50.0%	projekt	60.0%	40.0%
Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej													
sprawdzian teoretyczny	60.0%	10.0%													
sprawdziany z zadań obliczeniowych	60.0%	50.0%													
projekt	60.0%	40.0%													
Zalecana lista lektur	<table border="1" data-bbox="451 875 1487 1395"> <tr> <td data-bbox="451 875 794 925">Podstawowa lista lektur</td> <td colspan="2" data-bbox="794 875 1487 925">David G. Luenberger (2003), Teoria inwestycji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN.</td> </tr> <tr> <td data-bbox="451 925 794 1133">Uzupełniająca lista lektur</td> <td colspan="2" data-bbox="794 925 1487 1133">           D. Ruppert, S. Matteson (2015), Statistics and Data Analysis for Financial Engineering, Springer.             O. Linton (2019), Financial Econometrics: Models and Methods, Cambridge University Press.         </td> </tr> <tr> <td data-bbox="451 1133 794 1395">Adresy eZasobów</td> <td colspan="2" data-bbox="794 1133 1487 1395">           Podstawowe  <a href="https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf">https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf</a> - Książka na temat teorii portfelowej.            Uzupełniająca  <a href="https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r">https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r</a> - Kurs z analizy portfela inwestycyjnego na DataCamp.  <a href="http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf">http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf</a> - Analiza średniej-wariancji i model CAPM.         </td> </tr> </table>			Podstawowa lista lektur	David G. Luenberger (2003), Teoria inwestycji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN.		Uzupełniająca lista lektur	D. Ruppert, S. Matteson (2015), Statistics and Data Analysis for Financial Engineering, Springer.  O. Linton (2019), Financial Econometrics: Models and Methods, Cambridge University Press.		Adresy eZasobów	Podstawowe <a href="https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf">https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf</a> - Książka na temat teorii portfelowej. Uzupełniająca <a href="https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r">https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r</a> - Kurs z analizy portfela inwestycyjnego na DataCamp. <a href="http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf">http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf</a> - Analiza średniej-wariancji i model CAPM.				
Podstawowa lista lektur	David G. Luenberger (2003), Teoria inwestycji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN.														
Uzupełniająca lista lektur	D. Ruppert, S. Matteson (2015), Statistics and Data Analysis for Financial Engineering, Springer.  O. Linton (2019), Financial Econometrics: Models and Methods, Cambridge University Press.														
Adresy eZasobów	Podstawowe <a href="https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf">https://library.ku.ac.ke/wp-content/downloads/2011/08/Bookboon/Finance/portfolio-theory-financial-analyses.pdf</a> - Książka na temat teorii portfelowej. Uzupełniająca <a href="https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r">https://campus.datacamp.com/courses/introduction-to-portfolio-analysis-in-r</a> - Kurs z analizy portfela inwestycyjnego na DataCamp. <a href="http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf">http://www.columbia.edu/~mh2078/FoundationsFE/MeanVariance-CAPM.pdf</a> - Analiza średniej-wariancji i model CAPM.														
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Wyznacz betę dla wybranego aktywa.</li> <li>2. Skonstruuj portfel minimalnej wariancji</li> <li>3. Zakładając model błędzenia przypadkowego oblicz prawdopodobieństwo, że cena akcji wzrośnie w najbliższym miesiącu</li> </ol>														
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy														