



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	MODELE RYNKU KAPITAŁOWEGO, PG_00049994						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2022 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2023/2024		
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	niestacjonarne	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 Kochański					
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu	dr Błażej Kochański					
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	8.0	16.0	0.0	0.0	0.0	24
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	24	6.0		45.0		75
Cel przedmiotu	Nabywanie 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_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			
	[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			

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="448 703 1487 864"> <thead> <tr> <th data-bbox="448 703 794 734">Sposób oceniania (składowe)</th> <th data-bbox="794 703 1141 734">Próg zaliczeniowy</th> <th data-bbox="1141 703 1487 734">Składowa oceny końcowej</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="448 734 794 766">projekt</td> <td data-bbox="794 734 1141 766">60.0%</td> <td data-bbox="1141 734 1487 766">40.0%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="448 766 794 826">sprawdziany z zadań obliczeniowych</td> <td data-bbox="794 766 1141 826">60.0%</td> <td data-bbox="1141 766 1487 826">50.0%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="448 826 794 864">sprawdzian z teorii</td> <td data-bbox="794 826 1141 864">60.0%</td> <td data-bbox="1141 826 1487 864">10.0%</td> </tr> </tbody> </table>			Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej	projekt	60.0%	40.0%	sprawdziany z zadań obliczeniowych	60.0%	50.0%	sprawdzian z teorii	60.0%	10.0%
Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej													
projekt	60.0%	40.0%													
sprawdziany z zadań obliczeniowych	60.0%	50.0%													
sprawdzian z teorii	60.0%	10.0%													
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	David G. Luenberger (2003), Teoria inwestycji finansowych, Wydawnictwo Naukowe PWN.													
	Uzupełniająca lista lektur	<p>D. Ruppert, S. Matteson (2015), Statistics and Data Analysis for Financial Engineering, Springer.</p> <p>O. Linton (2019), Financial Econometrics: Models and Methods, Cambridge University Press.</p>													
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczenie: Modele rynku kapitałowego 2023/2024 - Moodle ID: 31453 <a href="https://enauczenie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=31453">https://enauczenie.pg.edu.pl/moodle/course/view.php?id=31453</a>													
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														