

KARTA PRZEDMIOTU

1.	NAZWA PRZEDMIOTU: Podstawy analizy fundamentalnej, technicznej i portfelowej
2.	KIERUNEK: Finanse i rachunkowość
3.	POZIOM STUDIÓW: studia pierwszego stopnia
4.	ROK/ SEMESTR STUDIÓW: III/6
5.	LICZBA PUNKTÓW ECTS: 3
6.	TYP PRZEDMIOTU¹: obowiązkowy
7.	JĘZYK WYKŁADOWY: polski
8.	LICZBA GODZIN I FORMA REALIZACJI PRZEDMIOTU²: (ZP) 45h
9.	WYMAGANIA WSTĘPNE: wiedza z przedmiotów w zakresie nauk podstawowych realizowanych na wcześniejszych semestrach

10.	ZAŁOŻENIA I CELE PRZEDMIOTU: <ul style="list-style-type: none"> – zapoznanie studentów z istotą analizy fundamentalnej, technicznej i portfelowej oraz metodami i narzędziami badawczymi przez nie stosowanymi, – nabycie przez studentów umiejętności dokonać samodzielnej analizy zagadnień związanych z rynkiem finansowym, – nabycie przez studentów praktycznych umiejętności zastosowania poznanych metod w analizie fundamentalnej, technicznej i portfelowej
-----	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

11.	PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się (symbol)
	WIEDZA: zna i rozumie	
P_W01	podstawowe pojęcia i procesy z zakresu analizy fundamentalnej, technicznej i portfelowej;	K_W03
P_W02	główne zasady przeprowadzania analiz fundamentalnej, technicznej i portfelowej;	K_W05

¹ Obowiązkowy, fakultatywny.

² Wykłady, ćwiczenia, laboratoria, konwersatoria.

P_W03	zna metody oceny efektywności inwestycji;	K_W06
	UMIEJĘTNOŚCI: potrafi	
P_U01	stosować wybrane narzędzia analizy portfelowej, technicznej i fundamentalnej w podejmowaniu decyzji inwestycyjnych na rynkach finansowych;	K_U01, K_U11, K_U12
P_U02	zastosować wybrane metody wyceny instrumentów finansowych;	K_U02, K_U11, K_U12
P_U03	dokonać oceny efektywności strategii inwestycyjnych;	K_U03, K_U11, K_U12
P_U04	przeprowadzić analizę rynku przy użyciu różnorodnych technik;	K_U04, K_U11, K_U12
P_U05	samodzielnie zarządzać portfelem inwestycyjnym	K_U07, K_U11, K_U12
	KOMPETENCJE SPOŁECZNE: jest gotów do	
P_K01	uznawania znaczenia wiedzy w rozwiązywaniu problemów poznawczych i praktycznych, ich identyfikacji oraz szukania rozwiązań; podejmowania przemyślanych działań na podstawie analiz i ocen występujących zjawisk i zdarzeń, które mają wpływ na funkcjonowanie podmiotów	K_K01

12.	METODY OCENY EFEKTÓW UCZENIA SIĘ			
	Symbol przedmiotowego efektu uczenia się	Metody (sposoby) oceny³	Typ oceny⁴	Forma dokumentacji
1.	P_W01, P_W02, P_W03,	Zaliczenie pisemne	Podsumowująca	Test na platformie Protokół ocen

³ Ocenianie ciągłe (bieżące przygotowanie do zajęć), śródsesemtralne zaliczenie pisemne, śródsesemtralne zaliczenie ustne, końcowe zaliczenia pisemne, końcowe zaliczenia ustne, egzamin pisemny, egzamin ustny, praca sesemtralna, ocena umiejętności ruchowych, praca dyplomowa, projekt, kontrola obecności

⁴ Formująca, podsumowująca.

2.	P_U01, P_U02, P_U03, P_U04, P_U05 P_K01	Ocenianie ciągle Kontrola obecności Śródsesestralne zaliczenie pisemne Bieżąca obserwacja nabywanych umiejętności przez studenta w trakcie zajęć bez wystawiania oceny	Formująca	Zadania praktyczne Lista obecności Kwestionariusze testów Protokół ocen
----	------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------	----------------------------------------------------------------------------------------------

13. KRYTERIA OCENY OSIĄGNIĘTYCH EFEKTÓW UCZENIA SIĘ *procentowe*

EFEKTY UCZENIA SIĘ	NA OCENĘ 3,0	NA OCENĘ 3,5	NA OCENĘ 4.0	NA OCENĘ 4,5	NA OCENĘ 5,0
P_W01	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_W02	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_W03	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_U01	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_U02	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_U03	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_U04	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_U05	51%-60%	61%-70%	71%-80%	81%-90%	91%-100%
P_K01	bez wystawiania oceny				

15. WARUNKI UZYSKANIA ZALICZENIA PRZEDMIOTU:

Osiągnięcie założonych efektów uczenia się i pozytywny wynik
+ obecność na zajęciach + uzyskanie minimum oceny 3,0 z ćwiczeń

16.	TREŚCI PROGRAMOWE		
	Treść zajęć	Forma zajęć⁵ (liczba godz.)	Symbol przedmiotowych efektów uczenia się
Zajęcia praktyczne			
1.	Wprowadzenie do inwestycji finansowych.	2	P_W01,
2.	Wprowadzenie do analizy technicznej.	2	P_W01, P_W02

⁵ Wykłady, ćwiczenia, laboratoria, samodzielne prowadzenie zajęć przez studenta.

3.	Analiza trendu (pojęcie trendu i kanału trendu, kierunki i stopnie trendu, poziomy wsparcia i oporu, linie trendu — dostosowanie, naruszenie i przełamanie, filtry cenowe i czasowe, minimalny ruch cen po przełamaniu trendu, proporcje między ruchami cen, ćwiczenia na danych rzeczywistych).	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_K01
4.	Wykorzystanie liczb Fibonacciego w analizie technicznej	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_K01
5.	Analiza wybranych formacji cenowych.	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_K01
6.	Średnie kroczące (definicje, rodzaje i zastosowanie średnich, posługiwanie się jedną średnią, sygnały płynące z dwóch średnich, koperty, wstęgi Bollingera, ćwiczenia na danych rzeczywistych).	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
7.	Oscylatory (pojęcie, stosowanie i ogólne zasady interpretacji, mierzenie impetu (momentum), RSI, ROC, MACD, CCI, oscylator stochastyczny, przykłady innych oscylatorów (zdefiniowanych w programie Abakus Gold II), dywergencje, ćwiczenia na danych rzeczywistych).	5	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
8.	Teoria Dowa i teoria fal Elliotta.	2	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
9.	Wykresy punktowo-symboliczne i świece japońskie.	2	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
8.	Wykorzystanie zaawansowanych funkcji programu Metastock.	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
9.	Analiza nastrojów rynkowych.	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U04, P_U05, P_K01
10.	Analiza fundamentalna.	4	P_W01, P_W02, P_W03, P_U01, P_U03, P_U04, P_U05, P_K01

11.	Analiza portfelowa.	4	P_W01, P_W02, P_U01, P_U02, P_U03, P_U04, P_U05, P_K01
-----	---------------------	---	-----------------------------------------------------------------

17.	METODY DYDAKTYCZNE: <ol style="list-style-type: none"> 1. Wykład konwersatoryjny 2. Ćwiczenia przedmiotowe 3. Praca indywidualna 4. Praca w grupie 		
-----	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--

18.	LITERATURA PODSTAWOWA⁶: <ol style="list-style-type: none"> 1. Borowski K., <i>Analiza techniczna. Średnie ruchome, wskaźniki i oscylatory</i>. Difin, 2017. 2. Elton E.J., Gruber M.J., <i>Nowoczesna teoria portfelowa i analiz papierów wartościowych</i>, WIG PRESS, Warszawa 1998. 3. Murphy J.J., <i>Analiza techniczna rynków finansowych</i>, WIG PRESS, Warszawa 1999. 4. Kowalke K., <i>Analiza fundamentalna. Wykorzystanie na rynku akcji w Polsce</i>, CeDeWu, 2016. LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA⁷: <ol style="list-style-type: none"> 5. Bensignor R., <i>Nowe koncepcje analizy technicznej</i>, Biblioteka Inwestora, Warszawa 2004. 6. Krustinger J., <i>Systemy transakcyjne. Sekrety mistrzów</i>, WIG PRESS, Warszawa 1998. 7. Nison S., <i>Świece i inne japońskie techniki analizowania wykresów</i>, WIG PRESS, Warszawa 1996. 8. Piekunko I., <i>Wykorzystanie teorii fal Elliotta na rynku kapitałowym na przykładzie Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie</i>, Politechnika Białostocka, Białystok 2004. 9. Pring M.J., <i>Podstawy analizy technicznej</i>, WIG PRESS, Warszawa 1998. 		
-----	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--

19.	OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA		
	Forma aktywności	Rodzaj zajęć	Liczba godzin na zrealizowanie aktywności w semestrze
	a) Realizacja przedmiotu: wykłady	Zajęcia wymagające	
	b) Realizacja przedmiotu: zajęcia praktyczne		45

⁶ Dostępna w czytelni, bibliotece, Internecie.

⁷ Dostępna w czytelni, bibliotece, Internecie.

	c) Realizacja przedmiotu: laboratoria		
	d) Egzamin		
	e) Godziny kontaktowe z nauczycielem		
	f)		
	g)		
	<i>Łączna liczba godzin zajęć realizowanych z udziałem prowadzącego (pkt. a + b + c + d + e...)</i>		45
	h) Przygotowanie się do zajęć	Samokształcenie	10
	i) Przygotowanie się do zaliczeń/kolokwίων		10
	j) Przygotowanie się do egzaminu/zaliczenia		
	k) Wykonanie zadań poza uczelnią		10
	l)		
	<i>Łączna liczba godzin zajęć realizowanych we własnym zakresie (pkt. h + i + j + k + l ...)</i>		30
	Razem godzin (zajęcia z udziałem prowadzącego + samokształcenie)		75
	Liczba punktów ECTS		3

20.	PROWADZĄCY PRZEDMIOT (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL, INSTYTUT, NR POKOJU KONSULTACJI)
-----	---------------------------------------------------------------------------------------------