

## KARTA PRZEDMIOTU

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

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

11.	PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się (symbol)
	<b>WIEDZA: zna i rozumie</b>	
P_W01	podstawowe pojęcia i procesy z zakresu analizy fundamentalnej, technicznej i portfelowej;	K_W03
P_W02	główne zasady przeprowadzania analizy fundamentalnej, technicznej i portfelowej;	K_W05, K_W06

<sup>1</sup> Obowiązkowy, fakultatywny, do wyboru.

<sup>2</sup> Wykłady, ćwiczenia, laboratoria, konwersatoria.

P_W03	metody oceny efektywności inwestycji w pojedyncze instrumenty oraz zna zasady konstruowania optymalnych portfeli inwestycyjnych;	K_W06
	<b>UMIEJĘTNOŚCI: potrafi</b>	
P_U01	ocenić wpływ zmieniającej się koniunktury rynkowej na portfel inwestycyjny;	K_U01, K_U11, K_U12
P_U02	wycenić wybrane instrumenty finansowe;	K_U02, K_U11, K_U12
P_U03	dokonać oceny efektywności strategii inwestycyjnych;	K_U03, K_U11, K_U12
P_U04	przeprowadzić analizę rynku inwestycyjnego przy użyciu różnorodnych technik; samodzielnie zbudować portfel inwestycyjny;	K_U04, K_U11, K_U12
P_U05	samodzielnie zarządzać portfelem inwestycyjnym;	K_U07, K_U11, K_U12
	<b>KOMPETENCJE SPOŁECZNE: jest gotów do</b>	
P_K01	weryfikacji poziomu swojej wiedzy i umiejętności, uznawania znaczenia wiedzy w rozwiązywaniu problemów praktycznych a także do korzystania z opinii ekspertów;	K_K01

12.	<b>METODY OCENY EFEKTÓW UCZENIA SIĘ</b>			
	<b>Symbol przedmiotowego efektu uczenia się</b>	<b>Metody (sposoby) oceny<sup>3</sup></b>	<b>Typ oceny<sup>4</sup></b>	<b>Forma dokumentacji</b>
1.	P_W01, P_W02, P_W03,	Zaliczenie pisemne	Podsumowująca	Test na platformie Protokół ocen

<sup>3</sup> Ocenianie ciągłe (bieżące przygotowanie do zajęć), śródsesestralne zaliczenie pisemne, śródsesestralne zaliczenie ustne, końcowe zaliczenia pisemne, końcowe zaliczenia ustne, egzamin pisemny, egzamin ustny, praca sesestralna, ocena umiejętności ruchowych, praca dyplomowa, projekt, kontrola obecności

<sup>4</sup> 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.	<b>TREŚCI PROGRAMOWE</b>		
	<b>Treść zajęć</b>	<b>Forma zajęć<sup>5</sup> (liczba godz.)</b>	<b>Symbol przedmiotowych efektów uczenia się</b>
<b>Zajęcia praktyczne</b>			
1.	Wprowadzenie do inwestycji finansowych.	2	P_W01,
2.	Wprowadzenie do analizy technicznej.	2	P_W01, P_W02

<sup>5</sup> 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.	<b>METODY DYDAKTYCZNE:</b> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Wykład konwencjonalny</li> <li>2. Prezentacje multimedialne</li> <li>3. Ćwiczenia przedmiotowe</li> </ol>		
-----	--	--	--

18.	<b>LITERATURA PODSTAWOWA</b> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Borowski K. <i>Analiza techniczna. Średnie ruchome, wskaźniki i oscylatory</i>. Difin, 2017.</li> <li>2. Czapiewski P. Niedziółka P. <i>Zarządzanie portfelem inwestycyjnym</i>. Difin 2016.</li> <li>3. Kahn M.N. <i>Analiza techniczna. Wprowadzenie do analizy wykresów giełdowych</i>. Wydawnictwo Gab. 2018.</li> <li>4. Kowalke K. <i>Analiza fundamentalna. Wykorzystanie na rynku akcji w Polsce</i>, CeDeWu, 2016.</li> <li>5. Pieloch-Babiarz A., Sajnog A. <i>Podstawy analizy fundamentalnej. Podejście strategiczne</i>. PWN, Łódź 2021.</li> </ol> <b>LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA<sup>6</sup>:</b> <ol style="list-style-type: none"> <li>6. Gluzicka A. <i>Wybrane metody dywersyfikacji portfeli inwestycyjnych</i>, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach 2018.</li> <li>7. Bulkowski T. N. <i>Fundamental Analysis and Position Trading: Evolution of a Trader</i>. John Wiley &amp; Sons 2013.</li> </ol>		
-----	---	--	--

19.	<b>OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA</b>		
	<b>Forma aktywności</b>	<b>Rodzaj zajęć</b>	<b>Liczba godzin na zrealizowanie aktywności w semestrze</b>
	a) Realizacja przedmiotu: wykłady	Zajęcia wymagające udziału	
	b) Realizacja przedmiotu: zajęcia praktyczne		45
	c) Realizacja przedmiotu: laboratoria		
	d) Egzamin		

<sup>6</sup> Dostępna w czytelni, bibliotece, Internecie

	e) Godziny kontaktowe z nauczycielem		
	f) .....		
	g) .....		
	<i>Łączna liczba godzin zajęć realizowanych z udziałem prowadzącego (pkt. a + b + c + d + e...)</i>		<b>45</b>
	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>		<b>30</b>
	<b>Razem godzin (zajęcia z udziałem prowadzącego + samokształcenie)</b>		<b>75</b>
	Liczba punktów ECTS		3

20.	<b>PROWADZĄCY PRZEDMIOT (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL, INSTYTUT, NR POKOJU KONSULTACJI)</b> mgr Jarosław Bielak <a href="mailto:jaroslaw.bielak@upz.edu.pl">jaroslaw.bielak@upz.edu.pl</a> Instytut Społeczno-Ekonomiczny, ul Zamoyskiego 64, p. 205.
-----	--