Opis zajęć (sylabus): Strategie inwestowania na rynku papierów wartościowych

Nazwa zajęć:	**Strategie inwestowania na rynku papierów wartościowych**	**ECTS**	**3**
Nazwa zajęć w j. angielskim:	Stock Exchange Investment Strategies		
Zajęcia dla kierunku studiów:	**Ekonomia**		

Język wykładowy: **polski**		Poziom studiów: **1**	
Forma studiów: **stacjonarne i niestacjonarne**	Status zajęć: **kierunkowy - do wyboru**	Numer semestru: **6** **semestr letni**	
Rok akademicki, od którego obowiązuje opis (rocznik):		**2020/2021**	Numer katalogowy: **EKR-E-1SZ-6-19-KF-2020**

Koordynator zajęć:	**dr hab. Sylwester Kozak, prof. SGGW**
Prowadzący zajęcia:	**dr hab. Sylwester Kozak, prof. SGGW**
Jednostka realizująca:	**Katedra Ekonomii i Polityki Gospodarczej**
Jednostka zlecająca:	**Wydział Ekonomiczny**
Założenia, cele i opis zajęć:	a. Pogłębienie wiedzy z zakresu funkcjonowania rynku papierów wartościowych. b. Przekazanie wiedzy na temat zasad konstruowania strategii inwestowania. c. Nabycie przez studenta umiejętności tworzenia strategii inwestycyjnej i skutecznego zarządzania środkami pieniężnymi. **Wykład** Rola rynku finansowego w gospodarce. Czynniki makroekonomiczne determinujące sytuację na rynku papierów wartościowych (polityka pieniężna, polityka fiskalna, koniunktura gospodarcza, wpływ globalizacji). Instrumenty finansowe na rynku papierów wartościowych. Wybrane koncepcje inwestowania na rynku akcji. Analiza fundamentalna - istota, etapy, wskaźniki, metody wyceny akcji. Analiza techniczna - analiza wykresów, trend, wybrane formacje i wskaźniki. Elementy analizy portfelowej. Psychologiczne aspekty inwestowania. Odstępstwa od efektywności rynku. Skłonności poznawcze inwestorów. Specyfika inwestycji w dłużne instrumenty finansowe. Strategia inwestycyjna i jej elementy. Planowanie inwestycji. Podstawowe zasady inwestowania. Czynniki wpływające na skuteczność systemu transakcyjnego. Ryzyko w strategii inwestycyjnej. Style inwestowania. Najczęstsze błędy popełniane przez inwestorów. **Ćwiczenia** Kryteria doboru spółek do portfela inwestycyjnego. Metody wyznaczania momentu zakupu papierów wartościowych. Określenie właściwej wielkości pozycji. Metody zarządzania wielkością pozycji. Metody wyznaczania momentu sprzedaży papierów wartościowych. Zlecenia stop loss i take profit. Ocena skuteczności systemu transakcyjnego. Termin zaliczenia: wystąpienie podczas zajęć i test w trakcie semestru.
Formy dydaktyczne, liczba godzin:	a. wykład - liczba godzin: stacj: 20, niestacj. 12 b. ćwiczenia audytoryjne - liczba godzin: stacj: 10, niestacj. 4
Metody dydaktyczne:	dyskusja, rozwiązywanie problemu, konsultacje, wykład konwersacyjny, studium przypadku, grupowe projekty studenckie
Wymagania formalne i założenia wstępne:	Nie dotyczy

Efekty uczenia się:	**Wiedza - Zna i rozumie:** 1. Zna i rozumie znaczenie i zasady funkcjonowania podmiotów gospodarczych oraz relacje i więzi łączące je z innymi instytucjami tworzącymi ich otoczenie w skali krajowej i międzynarodowe 2. Zna i rozumie metody i narzędzia, w tym techniki pozyskiwania danych, właściwe dla nauk ekonomicznych, pozwalające opisywać kategorie, struktury i instytucje gospodarczo-społeczne oraz procesy zachodzące w nich i między nimi	**Umiejętności - Potrafi:** 3. Potrafi wykorzystać wiedzę teoretyczną, dobrać właściwe metody i narzędzia oraz pozyskiwać dane do formułowania i analizowania prostych i złożonych procesów i zjawisk ekonomicznych, w tym dotyczących gospodarki żywnościowej 4. Potrafi organizować własną pracę oraz współdziałać i pracować w zespole, w tym interdyscyplinarnym, przyjmując w nim różne role	**Kompetencje - Jest gotów do:** 5. Jest gotów do krytycznej oceny posiadanej wiedzy w zakresie ekonomii, uznawania znaczenia wiedzy w rozwiązywaniu problemów oraz zasięgania opinii ekspertów w przypadku trudności z samodzielnym ich rozwiązaniem
Sposób weryfikacji efektów uczenia się:	ocena wystąpień w trakcie zajęć (efekty: 1,2,3,4,5), ocena wykonania zadania projektowego (efekty: 1,2,3,4,5), test (pisemny lub komputerowy) (efekty: 1,2)		

Forma dokumentacji osiągniętych efektów uczenia się:	prace pisemne, złożone projekty
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową:	ocena wystąpień w trakcie zajęć - 10%, ocena wykonania zadania projektowego - 70%, test (pisemny lub komputerowy) - 20%
Miejsce realizacji zajęć:	sala dydaktyczna (wykładowa/ćwiczeniowa)

Literatura podstawowa i uzupełniająca:

1. Podstawowa:
2. Elder A., Zawód inwestor giełdowy, Wyd. Wolters Kluwer Polska, Kraków 2001.
3. Tharp V.K., Giełda, wolność i pieniądze, Wyd. WIG-PRESS, Warszawa 2000.
4. Uzupełniająca:
5. Tharp V.K., Bezpieczne strategie inwestycyjne, Wyd. Oficyna Ekonomiczna, Kraków 2006.
6. Zalewski G., Kontrakty terminowe w praktyce, Wyd. WIG-PRESS, Warszawa 2006.
7. Jajuga K., Jajuga T.,Inwestycje, PWN,Warszawa 2008.
8. Graham B.,Inteligentny Inwestor, Studio Emka, Warszawa 2006.

Uwagi:

Wskaźniki ilościowe charakteryzujące moduł/przedmiot:	
Szacunkowa sumaryczna liczba godzin pracy studenta (kontaktowych i pracy własnej) niezbędna dla osiągnięcia zakładanych dla zajęć efektów uczenia się - na tej podstawie należy wypełnić pole ECTS:	**75/76**
Łączna liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich lub innych osób prowadzących zajęcia:	**1.4/0.84 ECTS**

Tabela zgodności kierunkowych efektów uczenia się z efektami przedmiotu:

Kategoria efektu	Efekty uczenia się dla zajęć:	Odniesienie do efektów dla programu studiów dla kierunku	Oddziaływanie zajęć na efekt kierunkowy*)
Wiedza	1. Zna i rozumie znaczenie i zasady funkcjonowania podmiotów gospodarczych oraz relacje i więzi łączące je z innymi instytucjami tworzącymi ich otoczenie w skali krajowej i międzynarodowe	EK1_KW02	2
	2. Zna i rozumie metody i narzędzia, w tym techniki pozyskiwania danych, właściwe dla nauk ekonomicznych, pozwalające opisywać kategorie, struktury i instytucje gospodarczo-społeczne oraz procesy zachodzące w nich i między nimi	EK1_KW03	2
Umiejętności	3. Potrafi wykorzystać wiedzę teoretyczną, dobrać właściwe metody i narzędzia oraz pozyskiwać dane do formułowania i analizowania prostych i złożonych procesów i zjawisk ekonomicznych, w tym dotyczących gospodarki żywnościowej	EK1_KU01	3
	4. Potrafi organizować własną pracę oraz współdziałać i pracować w zespole, w tym interdyscyplinarnym, przyjmując w nim różne role	EK1_KU05	3
Kompetencje	5. Jest gotów do krytycznej oceny posiadanej wiedzy w zakresie ekonomii, uznawania znaczenia wiedzy w rozwiązywaniu problemów oraz zasięgania opinii ekspertów w przypadku trudności z samodzielnym ich rozwiązaniem	EK1_KK01	2

*) 3 – zaawansowany i szczegółowy, 2 – znaczący, 1 – podstawowy