

Opis zajęć (syllabus): Strategie inwestycyjne na rynkach walutowych

Nazwa zajęć:	Strategie inwestycyjne na rynkach walutowych	ECTS	3
Nazwa zajęć w j. angielskim:	Investment strategies on foreign exchange markets		
Zajęcia dla kierunku studiów:	Finanse i Rachunkowość		

Język wykładowy: polski		Poziom studiów: 1	
Forma studiów: stacjonarne i niestacjonarne	Status zajęć: kierunkowy - do wyboru	Numer semestru: 3 semestr zimowy	
Rok akademicki, od którego obowiązuje opis (rocznik):		2020/2021	Numer katalogowy: EKR-F-1SZ-3-25-KF-2020

Koordinator zajęć:	dr Rafał Balina, adiunkt		
Prowadzący zajęcia:	dr Rafał Balina, adiunkt Pracownicy Katedry Finansów		
Jednostka realizująca:	Katedra Finansów		
Jednostka zlecająca:	Wydział Ekonomiczny		
Założenia, cele i opis zajęć:	a. Zapoznanie studentów z zasadami funkcjonowania rynków walutowych. b. Wskazanie różnic między rynkiem walutowym a pozostałymi rynkami finansowymi. c. Ocena skuteczności wybranych strategii inwestycyjnych. Wykład Charakterystyka rynków walutowych w tym rynku międzybankowego. Główne pary walutowe na rynkach walutowych. Mechanizmy handlu walutą. Czynniki wpływające na zmiany kursów walutowych. Analiza fundamentalna jako podstawowe źródło informacji o rynku walutowym. Znaczenie danych makroekonomicznych na kursy walut na rynkach światowych. Analiza techniczna i jej znaczenie w konstruowaniu strategii inwestycyjnych na rynku walutowym. Wybrane narzędzia analizy technicznej jako postawa konstruowania strategii krótkoterminowych na rynku walutowym. Zasady konstruowania strategii inwestycyjnych na rynkach walutowych. Określanie najkorzystniejszych momentów zawarcia transakcji kupna i sprzedaży. Zarządzanie i ograniczanie ryzyka w strategiach inwestycyjnych. Ćwiczenia Przeprowadzenie oceny skuteczności wybranych strategii inwestycyjnych na rynkach walutowych. Zapoznanie studentów ze źródłami danych fundamentalnych niezbędnych do prawidłowego konstruowania strategii inwestycyjnych. Przedstawienie wybranych metod i narzędzi analizy technicznej o dużym znaczeniu w inwestowaniu na rynkach walutowych. Określanie skuteczności strategii inwestycyjnych.		
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		
Wymagania formalne i założenia wstępne:	Ekonomia, Finanse przedsiębiorstw, Bankowość		
Efekty uczenia się:	Wiedza - Zna i rozumie: 1. Ma pogłębioną wiedzę o instrumentach finansowych oraz kryteriach ich wyboru w zależności od potrzeb podmiotów indywidualnych i instytucjonalnych działających na rynku.	Umiejętności - Potrafi: 2. Potrafi analizować przyczyny i przebieg konkretnych procesów i zjawisk z zakresu bankowości oraz formułować własne opinie, a także stawiać proste hipotezy badawcze i je weryfikować 3. Potrafi samodzielnie i krytycznie uzupełniać wiedzę i umiejętności z zakresu bankowości, rozszerzone o wymiar interdyscyplinarny	Kompetencje - Jest gotów do: 4. Potrafi wykorzystywać wiedzę teoretyczną do opisu i analizowania przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk z zakresu bankowości oraz potrafi formułować własne opinie i dobierać krytycznie dane i metody analiz.
Sposób weryfikacji efektów uczenia się:	ocena prac wykonywanych w ramach pracy własnej studenta (efekty: 1,2,3,4), ocena aktywności w trakcie zajęć (efekty: 1,2,3)		
Forma dokumentacji osiągniętych efektów uczenia się:	prace pisemne, karty oceny studenta (w tym na listach obecności), indywidualne projekty studenckie		
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową:	ocena prac wykonywanych w ramach pracy własnej studenta - 90%, ocena aktywności w trakcie zajęć - 10%		
Miejsce realizacji zajęć:	sala dydaktyczna (wykładowa/ćwiczeniowa)		

Literatura podstawowa i uzupełniająca:

1. Reilly F.K., Brown K.C., 2001: Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem. Tom 1 i 2. Wydawnictwo PWE. Warszawa.
2. Hull J.C., 2011: Zarządzanie ryzykiem instytucji finansowych. Wydawnictwo Naukowe PWN. Warszawa.
3. Schwager J., 1992: The New Market Wizards. Conversations with America's Top Traders. Harper Business. New York.
4. Balina R., Idasz-Balina M., 2018: Analiza techniczna w podejmowaniu decyzji inwestycyjnych na rynku walutowym. Wydawnictwo naukowe Intellect, Wałeczków.

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:	75/75
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. Ma pogłębioną wiedzę o instrumentach finansowych oraz kryteriach ich wyboru w zależności od potrzeb podmiotów indywidualnych i instytucjonalnych działających na rynku.	FIR1_KW04	2
Umiejętności	2. Potrafi analizować przyczyny i przebieg konkretnych procesów i zjawisk z zakresu bankowości oraz formułować własne opinie, a także stawiać proste hipotezy badawcze i je weryfikować	FIR2_KU01	2
	3. Potrafi samodzielnie i krytycznie uzupełniać wiedzę i umiejętności z zakresu bankowości, rozszerzone o wymiar interdyscyplinarny	FIR1_KU02	2
Kompetencje	4. Potrafi wykorzystywać wiedzę teoretyczną do opisu i analizowania przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk z zakresu bankowości oraz potrafi formułować własne opinie i dobierać krytycznie dane i metody analiz.	FIR1_KK01	2

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