

## Wycena instrumentów dłużnych (laboratorium) - 2019/2020

### Opis zajęć

#### Informacje ogólne

**Prowadzący:** dr Jacek Bednarz

**Organizator:** Wydział Nauk Społecznych - Instytut Ekonomii i Zarządzania

**Liczba godzin tydzień/semestr:** 1/15

**Język wykładowy:** Język polski

#### Cele przedmiotu

C1. Celem laboratorium jest samodzielne tworzenie projektów, które nawiązywałyby do tematyki aktualnej, odpowiadały na potrzeby praktyki gospodarczej, by łączyły teorię i praktykę.

C2. Tematy projektów mają prowadzić do autentycznego rozwiązywania poszczególnych zadań.

C3. Realizacja projektu uwzględnia komplet kompetencji przypisanych zajęciom projektowym, nie ograniczając się wyłącznie do aspektów teoretycznych (wiedzy) czy praktyki analitycznej (umiejętności).

C4. Laboratorium ma za zadanie główne kształtowanie kompetencji społecznych.

#### Wymagania wstępne

W1. Wskazane jest zaliczenie wykładu z Inwestowania na rynku kapitałowym i pieniężnym.

#### Efekty kształcenia dla przedmiotu

##### WIEDZA

K\_W09\_12 ma poszerzoną wiedzę z zakresu rynku kapitałowego i finansowego, uwzględniając analityczną specyfikę poszczególnych segmentów rynku finansowego oraz praktykę korzystania z usług instytucji systemu finansowego

##### UMIĘJĘTNOŚCI

K\_U06\_12 potrafi wycenić podstawowe instrumenty finansowe, jak: bony, certyfikaty depozytowe, weksle, obligacje czy akcje, uwzględniając ich rentowność oraz ryzyko inwestycyjne

##### KOMPETENCJE SPOŁECZNE

Posiadanie świadomości poziomu swojej wiedzy i umiejętności oraz rozumienia potrzeby ciągłego doksztalcania, rozwoju osobistego i doskonalenia umiejętności (zgodnie z efektem K\_K01),

Nabycie umiejętności współdziałania i pracy w zespole, rozwiązując grupowo problemy z zakresu ekonomii i praktyki gospodarczej (zgodnie z efektem K\_K02),

Nabycia umiejętności współpracy przy realizacji złożonych zadań, uwzględniając warunkujące je czynniki organizacyjne i środowiskowe (zgodnie z efektem K\_K03),

Wzmocnieniu umiejętności podejmowania wyzwań zawodowych, uwzględniając priorytety służące realizacji wyznaczonych zadań, zgodnie z hierarchizacją opartą o przyjęty system wartości, w duchu krytycyzmu (zgodnie z efektem K\_K05),

Wzmocnieniu umiejętności działania w sposób przedsiębiorczy (zgodnie z efektem K\_K07).

#### Metody dydaktyczne

Kolaz metod: wykład, seminarium, ćwiczenia i seminarium.

#### Treści programowe przedmiotu

Tematyką (wehikułem) służącą realizacji celów przedmiotu jest wycena instrumentów dłużnych.

1. Charakterystyka instrumentów dłużnych:

a. Prawna. Zapoznanie się z ustawą o obligacjach.

b. Ekonomiczno-finansowa.

2. Zapoznanie się z praktycznym zastosowaniem instrumentów dłużnych na świecie i w Polsce; studia przypadku.

3. Samodzielne przygotowanie sprawozdania /opisu/ - w grupach - z rzeczywistej emisji instrumentów dłużnych (przez podmioty sektora prywatnego lub publicznego) na rynku polskim w okresie ostatnich kilku lat.

Kryteria oceny i sposoby weryfikacji zakładanych efektów kształcenia

Ocena uwzględniać będzie:

1. Jak studenci poszczególnych grup zaprezentują w wybranej formie rozwiązania poszczególnych problemów, dokumentując projekt zgodnie z przyjętymi zasadami.
2. Jak wyglądała dyskusja między grupą prezentującą projekt a pozostałymi studentami (np. oceniając wypowiedź każdego studenta w grupie na każdej prezentacji).
3. Ponieważ zajęcia te mają uaktywnić wszystkich uczestników zajęć i chodzi o to, by studenci wykazali predyspozycje SPOŁECZNE oraz umiejętności prezentacji własnych pomysłów, wątpliwości i sugestie w zakresie problematyki wyceny instrumentów dłużnych (zgodnie z efektem K\_U07), obok kompetencji, ocena będzie uwzględniać aktywność studentów.

Literatura podstawowa i uzupełniająca

Literatura podstawowa:

1. Aktualna ustawa o obligacjach. Tekst jednolity. Polski Dom Obligacji SA. Strona internetowa.
2. Rynek finansowy i jego mechanizmy. W. Dębski, PWN, Warszawa 2016.
3. Inwestycje. K. i T. Jajuga. PWN, Warszawa 2016.
3. Instrumenty dłużne w gospodarce. I. Czechowska, CeDeWu 2013.

Literatura uzupełniająca:

1. Nowoczesna teoria portfelowa. M. Gruber i E. Elton. WIG Press, Warszawa 1998.
2. Inwestycje. J. C. Francis. Wig Press, Warszawa 2000.
3. Zarządzanie ryzykiem. K. Jajuga. PWN, Warszawa 2015.

Kierunek studiów: Ekonomia (stacjonarne II stopnia)

**Lokalizacja w planach rocznych:**

**Etap:** Rok II - Semestr 3

Punkty ECTS: 3

Forma zaliczenia: Zal. na ocenę

**Terminarz:**

Data	Dzień	Sala	Godz.od-do
2019-12-02	poniedziałek	CTW-203	15:50 - 17:30
2019-12-09	poniedziałek	CTW-203	15:50 - 17:30
2019-12-16	poniedziałek	CTW-203	15:50 - 17:30
2020-01-16	czwartek	C-507	19:10 - 20:50