

Opis przedmiotu

1. Nazwa przedmiotu: **Modele rynku finansowego**

2. Kod przedmiotu:

3. Język wykładowy: język polski

4. Kierunek: finanse i rachunkowość

5. Specjalność:

6. Rok: III Semestr: 6

7. Tytuł/stopień oraz imię i nazwisko prowadzącego przedmiot:

dr hab. Mariusz Czekala prof. PWSZ w Nysie

8. Tytuły/stopnie oraz imiona i nazwiska pozostałych członków zespołu:

mgr Agnieszka Szpara

9. Formy zajęć wchodzące w skład przedmiotu, wymiar godzinowy, forma zaliczenia:

Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia/ Ćwiczenia tablicowe	Laboratorium/ Ćwiczenia praktyczne	Projekt	Seminarium
Liczba godzin w semestrze	30	15			
Forma zaliczenia	Egzamin pisemny	kolokwia			

10. Liczba punktów ECTS: 5

11. Poziom (podstawowy/zaawansowany): zaawansowany

12. Wymagania wstępne:

matematyka finansowa, elementy statystyki, elementy ekonometrii

13. Cele kształcenia:

Zapoznanie studentów z wybranymi modelami funkcjonowania rynku ze szczególnym uwzględnieniem modeli ekonometrycznych oraz modeli szeregów czasowych

14. Opis treści kształcenia w ramach poszczególnych form zajęć:

14.1. Wykład:

Kryteria podejmowania decyzji inwestycyjnych na rynku finansowym. Rola i zadania modeli rynku finansowego. Model wyceny aktywów kapitałowych – CAPM. Modele wyceny instrumentów pochodnych. Modele probabilistyczne. Modele stochastyczne. Idea modeli fraktalnych. Modele z wykorzystaniem technologii informatycznych.. Modele średniej ruchomej i autoregresji oraz ich uogólnienia, niestandardowe modele ekonometryczne, elementy analizy technicznej.

14.2. Ćwiczenia/Ćwiczenia tablicowe:

Testowanie parametrów strukturalnych modeli ekonometrycznych. Analiza wybranych własności rozkładu reszt. Merytoryczna interpretacja parametrów strukturalnych oszacowanych modeli.

14.3 Laboratorium/ Ćwiczenia praktyczne.:

--

14.4. Projekt:

--

14.5. Seminarium :

--

15.Literatura podstawowa:

- Ekonometria, Metody, przykłady, zadania, Dziechciarz J. (red.), Wydaw. Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego we Wrocławiu, Wrocław 2002.
- Analiza fundamentalna i techniczna, Czekala M., , Wydaw. Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego we Wrocławiu, Wrocław 1997.
- Rynek finansowy i jego mechanizmy : podstawy teorii i praktyki / Wiesław Dębski - Wyd. 2 uaktual. dodr 1, Warszawa : Wydaw. Naukowe PWN, 2003.
- Rynek finansowy : szanse i zagrożenia rozwoju / red. Piotr Karpuś, Jerzy Węclawski
Rynek finansowy : szanse i zagrożenia rozwoju. T. 2. Zarządzanie finansami przedsiębiorstw i instytucji / red. Piotr Karpuś, Jerzy Węclawski ; Aurelia Bielawska [et al.]. - Lublin : Wydaw. Uniwersytetu Marii Curie-Skłodowskiej, 2005
- Rynek finansowy : szanse i zagrożenia rozwoju / red. Piotr Karpuś, Jerzy Węclawski
Rynek finansowy : szanse i zagrożenia rozwoju. T. 1. Instrumenty i strategie rynku finansowego / red. Piotr Karpuś, Jerzy Węclawski ; Grażyna Borys [et al.]. - Lublin : Wydaw. Uniwersytetu Marii Curie-Skłodowskiej, 2005.

16.Literatura towarzysząca:

--