

## SYLABUS PRZEDMIOTU W SZKOLE DOKTORSKIEJ

<b>Tytuł</b>	<b>Ekonomia Finansowa</b>
Tytuł w jęz. ang.	Financial Economics

<b>Status przedmiotu</b>	<b>obowiązkowy dla: kierunkowy SzD, kierunek Finanse</b>
	<b>do wyboru dla: SzD, kierunek Ekonomia</b>

<b>Autor/autorzy sylabusa:</b>	Zespół :	koordynator: dr Piotr Mielus
		członek zespołu
		członek zespołu

**Sygnatura przedmiotu:**

### Część A

**1. Syntetyczna charakterystyka przedmiotu (główne hasła – około 400 znaków):**

Przedstawienie słuchaczom powiązań pomiędzy ekonomią a finansami. Prezentacja kluczowych zagadnień odnośnie podejmowania decyzji finansowych w warunkach niepewności. Sformułowanie podstawowych praw ekonomii na rynku finansowym. Zarządzanie ryzykiem w finansach. Wprowadzenia pojęcia płynności finansowej i płynności rynku. Podstawowe zasady wyceny instrumentów finansowych. Wpływ czynników ekonomicznych na wycenę aktywów.

**2. Słowa kluczowe (3 – 6 słów):**

Rynek finansowy, ryzyko finansowe, płynność finansowa, instrumenty finansowe

### Część B

**Przedmiotowe efekty uczenia się**

**Powiązanie z efektami uczenia się dla SzD**

**Wiedza (liczba efektów od 2 do 5)**

W.1	Znać podstawowe zasady wymiarowania ryzyka na rynku finansowym.	W_2, W_3
W.2	Rozumieć proces kształtowania płynności i potrafić przeprowadzić	W_2, W_3

	analizę ekonomiczną do wyznaczenia pozycji płynności.	
W.3	Posiadać wiedzę o wycenie podstawowych instrumentów finansowych i ich wykorzystaniu w zarządzaniu ryzykiem.	W_2, W_3
<b>Umiejętności</b> (liczba efektów od 2 do 5)		
U.1	Rozumieć powiązania pomiędzy ekonomią a finansami i różnice pomiędzy tymi dwiema subdyscyplinami.	U_2, U_4
U.2	Znać pojęcia płynności finansowej i płynności rynku oraz potrafić je definiować, wymiarować i nimi zarządzać.	U_2, U_4
U.3	Umieć wymiarować ryzyko i wyceniać portfel zbudowany z podstawowych typów instrumentów finansowych.	U_2, U_4
<b>Kompetencje społeczne</b> (liczba efektów od 1 do 3)		
K.1	Rozumieć wpływ finansów na obrót gospodarczy.	K_3, K_6
K.2	Znać interakcje pomiędzy dobrobytem społecznym i wdrażaniem odpowiednich praktyk zarządzania finansami.	K_3, K_6

## Część C

### Semestralny plan zajęć:

1. Teoria rynku finansowego
2. Ekonomiczna analiza rynku finansowego
3. Decyzje finansowe w warunkach ryzyka
4. Wymiarowanie ryzyka
5. Teorie równowagi na rynku kapitałowym
6. Teoria efektywności i oczekiwań
7. Teoria niekompletnych rynków
8. Pojęcie płynności finansowej
9. Miary płynności rynku
10. Instrumenty finansowe
11. Wprowadzenie do wyceny aktywów
12. Elementy inżynierii finansowej

### **Literatura podstawowa** (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):

1. Fabozzi, Neave, Zhou; Financial Economics; Wiley 2012
2. Cuthbertson, Nitzsche; Quantitative Financial Economics; Wiley 2004
3. LeRoy, Werner; Principles of Financial Economics; CUP 2014
4. Sławiński, Rynki finansowe, PWE 2006

5. Dębski, Rynek finansowy i jego mechanizmy, PWN 2006

**Literatura uzupełniająca** (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):

1. Duffie, Dynamic Asset Pricing; PUP 2010
2. Magill, Quinzii, The Theory of Incomplete Markets, MIT 2002
3. Neftci, Principles of Financial Engineering, Academic Press 2004
4. Duffie, Security Markets, Stochastic Models, Emerald 1988
5. Pennachil Theory of Asset Pricing, Pearson 2008
6. Cochrane, Asset Pricing, LeRoy 2005

### Część D

<b>Forma zajęć:</b> wykład	<b>Wymiar zajęć w godz.:</b> 60
Ogółem godzin w tym:	60
<b>Elementy oceny końcowej (ogółem 100%), w tym:</b>	
Egzamin pisemny	100%
<b>Liczba punktów ECTS</b>	7

### Część E

<b>Metody dydaktyczne (nauczania) stosowane przez prowadzącego</b>
M.1. wykład tradycyjny

### Część F

<b>Metody weryfikacji (sprawdziany) osiągnięcia przedmiotowych efektów kształcenia</b>
W.1. egzamin pisemny (pytania otwarte, zadania) W.4. test

