

## 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: 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	Doktorant zna podstawowe zasady wymiarowania ryzyka na rynku finansowym.	W_2, W_3
W.2	Doktorant rozumie proces kształtowania płynności i potrafi przeprowadzić analizę ekonomiczną do wyznaczenia pozycji płynności.	W_2, W_3

W.3	Doktorant posiada 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	Doktorant rozumie powiązania pomiędzy ekonomią a finansami i różnice pomiędzy tymi dwiema dyscyplinami.	U_2 U_4
U.2	Doktorant zna pojęcia płynności finansowej i płynności rynku oraz potrafi je definiować, wymiarować i nimi zarządzać.	U_2 U_4
U.3	Doktorant zna metody pomiaru ryzyka i umie wyceniać portfel zbudowany z podstawowych typów instrumentów finansowych.	U_2 U_4
<b>Kompetencje społeczne</b> (liczba efektów od 1 do 3)		
K.1	Doktorant rozumie wpływ finansów na obrót gospodarczy.	K_3 K_6
K.2	Doktorant zna 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. Pomiar 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

oraz wybrane artykuły

### Część D

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

### Część E

**Metody dydaktyczne (nauczania) stosowane przez prowadzącego**

M.1. wykład tradycyjny

### Część F

**Metody weryfikacji (sprawdziany) osiągnięcia przedmiotowych efektów kształcenia**

W.1. egzamin pisemny (pytania otwarte, zadania)  
W.4. test