POLITECHNIKA BYDGOSKA
Wydział Zarządzania

Karta przedmiotu

# Analiza techniczna rynków finansowych

## 1. Informacje podstawowe

| | |
|---|---|
| **Kierunek studiów**<br>finanse i rachunkowość<br>**Specjalność**<br>-<br>**Jednostka zarządzająca kierunkiem studiów**<br>Wydział Zarządzania<br>**Poziom studiów**<br>drugiego stopnia (mgr)<br>**Profil studiów**<br>Profil praktyczny<br>**Forma studiów**<br>studia stacjonarne | **Cykl kształcenia (nabór)**<br>2024/25<br>**Kod przedmiotu**<br>08FIR-PS.DM2C.3291.24<br>**Języki wykładowe**<br>polski<br>**Obligatoryjność**<br>Fakultatywny<br>**Blok zajęciowy**<br>Przedmioty kierunkowe |

| | |
|---|---|
| **Wymagania wstępne** | Wiedza z zakresu rynków finansowych |
| **Przedmioty wprowadzające** | brak |
| **Koordynator** | Zbigniew Drewniak |

| **Okres** | **Forma i godziny zajęć** | **Liczba punktów ECTS** |
|---|---|---|
| Semestr 2 | • Wykład: 15, Egzamin<br>• Ćwiczenia audytoryjne: 15, Zaliczenie na ocenę<br>• Ćwiczenia laboratoryjne: 15, Zaliczenie na ocenę | 3 |

## 2. Efekty uczenia się dla przedmiotu

| **Kod** | **Opis efektów uczenia się** | **Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się** | **Odniesienie do charakterystyk PRK** |
|---|---|---|---|

| Kod | Opis efektów uczenia się | Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się | Odniesienie do charakterystyk PRK |
|---|---|---|---|
| **Wiedza:** | | | |
| W1 | Zna i rozumie pogłębioną terminologię z zakresu analizy technicznej rynków finansowych. | FIR_P2_K_W02 | P7S_WG |
| W2 | Zna i rozumie metody i narzędzia pozwalające na pozyskiwanie, analizowanie i prezentowanie danych w zakresie analizy technicznej rynków finansowych. | FIR_P2_K_W05 | P7S_WG |
| **Umiejętności:** | | | |
| U1 | Potrafi wykorzystać pogłębioną wiedzę z zakresu analizy technicznej do podejmowania decyzji inwestycyjnych na rynku finansowym. | FIR_P2_K_U01 | P7S_UW |
| U2 | Potrafi dobierać metody i narzędzia analizy technicznej do analizy i oceny zjawisk zachodzących na rynku finansowym. | FIR_P2_K_U07 | P7S_UW |
| **Kompetencje społeczne:** | | | |
| K1 | Jest gotów wykorzystać wiedzę z zakresu analizy technicznej w podejmowaniu decyzji inwestycyjnych w sposób efektywny i etyczny. | FIR_P2_K_K04 | P7S_KR |

## 3. Treści programowe

| Lp. | Treści programowe | Formy zajęć | Efekty uczenia się dla przedmiotu |
|---|---|---|---|
| 1. | Główne założenia i teorie analizy technicznej. | Wykład | W1 |
| 2. | Rodzaje wykresów, pojęcie trendu, linie wsparcia i oporu. | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, W2, U2, K1 |
| 3. | Formacje cenowe | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, W2, U1, U2, K1 |
| 4. | Wskaźniki analizy technicznej | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, W2, U1, U2, K1 |
| 5. | Teoria świec japońskich | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, W2, U1, U2, K1 |
| 6. | Teoria liczb/poziomów Fibonacciego | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, W2, U1, U2, K1 |
| 7. | W ramach ćwiczeń audytoryjnych studenci prezentują wybrany wskaźnik analizy technicznej. | Ćwiczenia audytoryjne | U1, U2, K1 |

## 4. Metody prowadzenia zajęć, weryfikacji efektów uczenia się i warunki zaliczenia

| Forma zajęć | |
|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| Wykład | **Metody prowadzenia zajęć:** | |
| | Wykład | |
| | **Metody (sposoby) weryfikacji:** | **Udział:** |
| | Egzamin pisemny | 100% |
| | **Warunki zaliczenia przedmiotu:** | |
| | Test składający się z pytania otwartego, pytań typu prawda/fałsz oraz pytań testowych. Możliwość uzyskania dodatkowych punktów za aktywność na zajęciach. | |
| Ćwiczenia audytoryjne | **Metody prowadzenia zajęć:** | |
| | Pokaz | |
| | **Metody (sposoby) weryfikacji:** | **Udział:** |
| | Prezentacja | 100% |
| | **Warunki zaliczenia przedmiotu:** | |
| | Prezentacja wksaźnika analizy technicnzej lub jednej z teorii analizy technicznej z podaniem przykładu (ocenie podlega poprawność metodyczna oraz krytyczne podejście do analizowanego przykładu). | |
| Ćwiczenia laboratoryjne | **Metody prowadzenia zajęć:** | |
| | Ćwiczenia laboratoryjne | |
| | **Metody (sposoby) weryfikacji:** | **Udział:** |
| | Portfolio | 100% |
| | **Warunki zaliczenia przedmiotu:** | |
| | Praca przy komputerze polegająca na analizie wykresów poprzez umiejetność wyznaczania trendu, identyfikowania formacji cenowych oraz interpretacji wskaźników analizy technicznej w kontekście podejmowania decyzji inwestycyjnych. Studenci tworzą portfolio rozwiązań zadań polegających na przykładach zastosowania wskaźników analizy technicznej z zastosowaniem programów do analizy technicznej. | |

| Efekt uczenia się dla przedmiotu | **Metody (sposoby) weryfikacji** | | |
|---|---|---|---|
| | Egzamin pisemny | Prezentacja | Portfolio |
| W1 | x | | x |
| W2 | x | | x |
| U1 | | x | x |
| U2 | | x | x |
| K1 | | x | x |

## 5. Literatura

**Literatura podstawowa**


1. Murphy J., 1999. Technical Analysis of the Financial Markets: A Comprehensive Guide to Trading Methods and Applications, New York Institute of Finance.
2. Borowski K., 2017. Analiza techniczna. Średnie ruchome i oscylatory, Difin.


**Literatura uzupełniająca**


1. Danielewicz P., 2015. Geometria Fibonacciego. Nowe ujęcie, Maklerska.pl.
2. Nison S., 1999. Świece i inne japońskie techniki analizowania wykresów, WIG-Press.


## 6. Nakład pracy studenta - bilans godzin i punktów ECTS

| Aktywność studenta | | Obciążenie studenta Liczba godzin |
|---|---|---|
| Zajęcia prowadzone z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego lub innych osób prowadzących zajęcia | Wykład | 15 |
| | Ćwiczenia audytoryjne | 15 |
| | Ćwiczenia laboratoryjne | 15 |
| Praca własna studenta | Przygotowanie do egzaminu | 15 |
| | Przygotowanie do zajęć | 13 |
| | Przygotowanie prezentacji multimedialnej | 10 |
| | Konsultacje | 7 |
| **Łączny nakład pracy studenta** | | 90 |
| **Liczba punktów ECTS** | | 3 |

* Godzina (dydaktyczna) oznacza 45 minut