

## **NOWOCZESNE TEORIE FINANSÓW**

### **wykład do wyboru**

1. Tytuł kursu: „Nowoczesne teorie finansów”
2. Semestr: 8
3. Autor kursu: Michał Muszyński
4. Opis kursu: Kurs pozwala na zapoznanie studentów z nowoczesnymi teoriami finansów prezentowanymi w literaturze z zaprezentowaniem ich zastosowania w praktyce.
5. Tematyka poszczególnych zajęć:
  1. Nowoczesne ujęcie tradycyjnych modeli równowagi rynku kapitałowego (2h)
  2. Elementy nowoczesnej teorii portfela (2h)
  3. Podstawy teorii informacji (2h)
  4. Behawioralna teoria finansów (2h)
  5. Teoria koherentnych miar ryzyka (2h)
  6. Teoria dominacji stochastycznych (2h)
  7. Teorie efektywności rynku (2h)
  8. Test zaliczeniowy (1)
2. Literatura (maksimum 5 pozycji podstawowych i 5 pozycji uzupełniających):
  1. Cover T. M., Thomas J.A.: „Elements of Information Theory”, John Willey & Sons, 1991.
  2. Elton E. J., Gruber M. J.: „Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych”, WigPress, Warszawa 1998.
  3. Trzpiot G.: „Dominacje w modelowaniu i analizie ryzyka na rynku finansowym”, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Karola Adamieckiego w Katowicach, Katowice 2006.
  4. Ziarko-Siwiek U.: „Efektywność informacyjna rynku finansowego w Polsce”, CeDeWu, Warszawa 2005.
  5. Zielonka P.: „Behawioralne aspekty inwestowania na rynku papierów wartościowych”, CeDeWu, Warszawa 2006.
3. Wymagania wstępne: Uczestnik kursu powinien posiadać wiadomości z przedmiotów: Podstawy rynków finansowych, Podstawy rynku kapitałowego i pieniężnego, Matematyka, Statystyka, Ekonometria, Finanse przedsiębiorstw.

4. Efekty kształcenia – umiejętności i kompetencje: Po zakończeniu uczestnik kursu powinien orientować się w nowoczesnych teoriach finansów, znać ich zastosowanie i aktualny stan rozwoju.
5. Forma kursu: wykład
6. Liczba godzin w semestrze: 15
7. Liczba miejsc: 50
8. Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę