

Popis předmětu

Zkratka předmětu:	UPEM/FFIN	Strana:	1 / 4
Název předmětu:	Finanční investování		
Akademický rok:	2023/2024	Tisknuto:	04.06.2024 23:56

Pracoviště / Zkratka	UPEM / FFIN			Akademický rok	2023/2024
Název	Finanční investování			Způsob zakončení	Zkouška
Akreditováno/Kredity	Ano, 5 Kred.			Forma zakončení	Kombinovaná
Rozsah hodin	Přednáška 2 [HOD/TYD] Cvičení 2 [HOD/TYD]			Zápočet před zkouškou	ANO
Obs/max	Statut A	Statut B	Statut C	Počítán do průměru	ANO
Letní semestr	84 / -	0 / -	0 / -	Min. (B+C) studentů	nestanoveno
Zimní semestr	0 / -	0 / -	0 / -	Opakovaný zápis	NE
Rozvrh	Ano			Vyučovaný semestr	Letní semestr
Vyučovací jazyk	Čeština			Počet dnů praxe	0
Volně zapisovatelný předmět	Ano			Hodn. stup. zp. před zk.	S/N
Hodnotící stupnice	A B C D E F				
Počet hodin kontaktní	Ne				
Automat. uzn. záp. před zk.	Ne				
Periodicita	K				
Nahrazovaný předmět	UPEM/PFIN				
Vyloučené předměty	Nejsou definovány				
Podmiňující předměty	Nejsou definovány				
Předměty informativně doporučené	Nejsou definovány				
Předměty, které předmět podmiňuje	Nejsou definovány				

Cíle předmětu (anotace):

Hlavním cílem předmětu Finanční investování je prohloubení znalostí kapitálového trhu a cenných papírů využitím investičních analýz - fundamentální, technické a psychologické.

Požadavky na studenta

Zápočet: aktivní účast na cvičeních s docházkou dle vyhlášky FES, vypracování seminární práce a aktivní zapojení do výukového programu zaměřeného na finanční investice.

Zkouška: písemná, ústní nebo distanční. Požadovaná minimální hranice úspěšnosti je 65 %.

Obsah

Investiční proces, podstata a druhy investic, časová hodnota peněz.
Investiční kritéria, měření výnosu a rizika investic do cenných papírů.
Finanční a dividendová politika akciových společností.
Fundamentální analýza akcií.
Modely výpočtu vnitřní hodnoty akcie u fundamentální analýzy.
Technická analýza, grafické modely, Elliotova teorie vln a indikátory.
Psychologická analýza, psychologické přístupy.
Dluhopisové analýzy, druhy výnosů, vnitřní hodnota a duration.
Ratingové hodnocení dluhopisů, ratingové agentury a stupnice.
Teorie portfolia, Markowitzův model, vhodně volené, efektivní a optimální portfolio.
Teorie portfolia, model CAPM, systematické a jedinečné riziko.
Řízení investic a portfolia.
Kolektivní investování, investiční zaměření fondů, měření výkonnosti fondů.

Předpoklady - další informace k podmíněnosti studia předmětu

Získané způsobilosti

Student, který úspěšně absolvoval předmět, umí:

- vysvětlit problematiku investičních portfolií včetně určení predikcí možného vývoje investičních instrumentů zahrnutých ve skladbě investic;
- vysvětlit důvody pro sestavování skladby investic a diverzifikaci rizika;
- vysvětlit investiční kritéria u investic;
- využívat investiční instrumenty v podnikové praxi;
- vysvětlit rozdíly mezi reálnými a finančními investicemi včetně výhod a nevýhod vyplývajících zjednotlivých investic;
- charakterizovat jednotlivé druhy výnosů u investic;
- charakterizovat vnitřní hodnotu akcie včetně modelů a vysvětlit zda je akcie nadhodnocená, podhodnocená nebo správně oceněná;
- vysvětlit rozdíly mezi jednotlivými investičními analýzami.

Student, který úspěšně absolvoval předmět, dovede:

- měřit výnosy a rizika investic do cenných papírů;
- vypočítat vnitřní hodnotu u akcií využitím modelů jako jsou např. dividendové modely, bilanční modely, ziskové modely a formulovat doporučení zda je akcie podhodnocená, nadhodnocená nebo správně oceněná;
- provádět investiční doporučení pro začínající, ale i profesionální investory;
- provádět analýzu informací, dat a odhadů využitím investičních analýz - fundamentální, technické a psychologické
- orientovat se v oblasti kapitálových trhů a jejich investičních možnostech;
- přijmout rozhodnutí, které investiční instrumenty budou zahrnuty do portfolia a vysvětlit důvody volby využitím míry korelace;
- sestavit a vyhodnotit portfolio investic, srozumitelně a přesvědčivě jej vysvětlit a doporučit řešení začínajícím a profesionálním investorům;
- predikovat očekávaný výnos s určitou mírou rizika podle druhu investičního instrumentu;
- orientovat se v investičním prostředí;
- uskutečňovat investiční záměry do finančních investic on-line přes licencované obchodníky na území České republiky.

Student, který úspěšně absolvoval předmět, je schopen:

- porozumět jednotlivým investičním analýzám a investicím;
- poskytovat a sdělovat srozumitelně profesionálním a začínajícím investorům informace o investičních možnostech na trzích;
- porozumět jednotlivým druhům výnosů plynoucích z jednotlivých investic;
- investovat na akciových trzích využitím fundamentální, technické a psychologické analýzy.

Studijní opory**Garanti a vyučující**

- **Garanti:** Ing. Josef Novotný, Ph.D. (100%)
- **Přednášející:** Ing. Josef Novotný, Ph.D. (100%)
- **Cvičící:** Ing. Josef Novotný, Ph.D. (100%)

Literatura

- **Základní:** VESELÁ, J.: *Investování na kapitálových trzích*. Praha: Wolters Kluwer, 2011.
- **Základní:** MUSÍLEK, P.: *Trh cenných papírů*. Praha: Ekopress, 2011.
- **Doporučená:** JÍLEK, J.: *Akciové trhy a investování*. Praha: Grada Publishing, 2009.
- **Doporučená:** REJNUŠ, O.: *Finanční trhy*. Praha: Grada Publishing, 2014.
- **Doporučená:** POLÁCH, J., et al. *Reálné a finanční investice*. Praha: C. H. Beck, 2012.
- **Doporučená:** SHILLER, J., R.: *The subprime solution how today's global financial crisis happened, and what to do about it*. Oxford: Princeton University Press, 2008.

Časová náročnost**Všechny formy studia**

Aktivita	Časová náročnost aktivity [h]
Příprava na zkoušku	44
Sběr materiálu	18
Příprava na zápočet	14

Vypracování seminární práce	22
Účast na výuce	52
Celkem:	150

Vyučovací metody

Monologická (výklad, přednáška, instruktáž)
 Dialogická (diskuze, rozhovor, brainstorming)
 Metody práce s textem (učebnicí, knihou)

Hodnotící metody

Ústní zkouška
 Písemná zkouška

Předmět je zařazen do studijních programů:

Studijní program	Typ stud.	Forma stud.	Obor	Etapa	V.st.pl.	Rok	Blok	Statut	D.roč.	D.sem.
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Ekonomika a management podniku	1	2021	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Ekonomika a management podniku	1	2023	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Ekonomika a management podniku	1	2019	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Ekonomika a management podniku	1	2020	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Ekonomika a management podniku	1	2022	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Management finančních institucí	1	2022	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Management finančních institucí	1	2023	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Management finančních institucí	1	2021	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Ekonomika a management	Navazující	Prezenční	Management finančních institucí	1	2020	2023	1. ročník - společné povinné předměty	A	1	LS
Finance	Navazující	Prezenční	Finance	1	2023	2023	povinné volitelné předměty	B	1	LS

Studijní program	Typ stud.	Forma stud.	Obor	Etapa	V.st.pl.	Rok	Blok	Statut	D.roč.	D.sem.
Finance	Navazující	Prezenční	Finance	1	2021	2023	povinně volitelné předměty	B	1	LS
Finance	Navazující	Prezenční	Finance	1	2022	2023	povinně volitelné předměty	B	1	LS
Aplikovaná informatika - Data Science pro business	Navazující	Prezenční	Aplikovaná informatika - Data Science pro business	1	2023	2023	volitelné předměty	C	1	LS