



## KARTA OPISU PRZEDMIOTU - SYLABUS

Nazwa przedmiotu

Modelowanie i analiza procesów finansowych [S2IZarz1-ZZiPP>MiAPF]

### Przedmiot

Kierunek studiów

Inżynieria zarządzania

Rok/Semestr

2/3

Studia w zakresie (specjalność)

Zarządzanie zasobami i procesami przedsiębiorstw

Profil studiów

ogólnoakademicki

Poziom studiów

drugiego stopnia

Język oferowanego przedmiotu

polski

Forma studiów

stacjonarne

Wymagalność

obligatoryjny

### Liczba godzin

Wykład

15

Laboratorium

0

Inne (np. online)

0

Ćwiczenia

15

Projekty/seminaria

0

### Liczba punktów ECTS

1,00

### Koordynatorzy

dr Joanna Małecka

joanna.malecka@put.poznan.pl

### Wykładowcy

### Wymagania wstępne

**WIEDZA:** Student zna podstawowe pojęcia dotyczące finansów i rynku finansowego. Ma ogólną wiedzę na temat funkcjonowania gospodarki, zarządzania nią oraz o rynku finansowym. Student orientuje się w zakresie struktur rynku pieniężnego i kapitałowego. **UMIEJĘTNOŚCI:** Student posiada umiejętności dostrzegania, kojarzenia i interpretowania zjawisk zachodzących w gospodarce. Posiada umiejętności prowadzenia obliczeń z zakresu analizy matematycznej. **KOMPETENCJE SPOŁECZNE:** Student potrafi formułować samodzielne oceny w zakresie polityki społeczno-gospodarczej, a także argumentować zajmowane stanowisko i bronić swoich opinii. Powinien wykazywać gotowość do podjęcia współpracy w ramach zespołu i skutecznie wyszukiwać informacji w Bibliotekach i w Internecie.

### Cel przedmiotu

Rozumienie przez Studentów podstawowych mechanizmów funkcjonowania systemu finansowego w gospodarce narodowej i ich wpływu na decyzje finansowe podejmowane przez poszczególne podmioty gospodarcze. Rozwijanie u Studentów umiejętności doboru różnych instrumentów rynku finansowego w zakresie pozyskiwania efektywnego źródła finansowania. Umiejętność przeprowadzenia analizy procesów finansowych zachodzących w przedsiębiorstwie i na jej podstawie doboru adekwatnego modelu - źródła finansowania - do potrzeb i perspektyw przedsiębiorstwa.

## Przedmiotowe efekty uczenia się

### Wiedza:

Student opisuje zaawansowane metody i narzędzia modelowania procesów finansowych i decyzyjnych w kontekście finansowym [P7S\_WG\_02]

Student identyfikuje wpływ struktur organizacyjnych na procesy finansowe w przedsiębiorstwach [P7S\_WG\_05].

Student charakteryzuje zależności finansowe w organizacjach i ich wpływ na decyzje finansowe [P7S\_WG\_06].

Student wyjaśnia zastosowanie nauk o zarządzaniu w kontekście procesów finansowych [P7S\_WG\_08].

### Umiejętności:

Student analizuje i interpretuje przyczyny i przebieg procesów finansowych [P7S\_UW\_01].

Student prognozuje i modeluje złożone procesy finansowe, wykorzystując zaawansowane metody zarządzania [P7S\_UW\_02].

Student opracowuje innowacyjne rozwiązania problemów finansowych [P7S\_UW\_04].

Student formułuje hipotezy dotyczące procesów finansowych w przedsiębiorstwach i dokonuje ich analizy [P7S\_UW\_07].

### Kompetencje społeczne:

Student integruje wiedzę interdyscyplinarną w celu efektywnego zarządzania procesami finansowymi [P7S\_KK\_01].

Student identyfikuje i ocenia przyczynowo-skutkowe zależności w realizacji strategii finansowych [P7S\_KK\_02].

Student planuje i zarządza przedsięwzięciami finansowymi w kontekście biznesowym [P7S\_KO\_03].

## Metody weryfikacji efektów uczenia się i kryteria oceny

Efekty uczenia się przedstawione wyżej weryfikowane są w następujący sposób:

**WYKŁAD:** oceny formujące możliwe do uzyskania za: aktywność w dyskusjach prowadzonych na wykładach (dotyczy kwestii bieżących i podsumowujących poszczególne wykłady lub zadany wcześniej materiał (np. książki, filmy, artykuły)) dająca możliwość oceny zrozumienia przez Studenta poruszanej problematyki; prace pisemne zadane w trakcie semestru (np. esej), egzamin pisemny (np. eKursy test lub tradycyjny). Ocena podsumowująca: średnia arytmetyczna z ocen formujących z warunkami zaokrąglenia podanymi i umieszczonymi na platformie eKursy - brak możliwości uzyskania zaliczenia bez napisania egzaminu na ocenę pozytywną (min. 60% punktów).

**ĆWICZENIA:** Ocena formująca: bieżąca aktywność na zajęciach i udział w dyskusjach; wejściówki składające się z min. 10 pytań; prace pisane na podstawie zadanych książek, artykułów lub filmów; wykonanie raportu finansowego lub porównania ofert rynkowych na zadany temat i jego wygłoszenie w trakcie zajęć; zadania typu cas-study; zadania w Excel umieszczane na eKursach; kolokwium końcowego. Ocena podsumowująca: średnia arytmetyczna z ocen formujących z warunkami zaokrąglenia podanymi i umieszczonymi na platformie eKursy - brak możliwości uzyskania zaliczenia bez napisania kolokwium na ocenę pozytywną (min. 60% punktów).

## Treści programowe

Treści programowe obejmują wiedzę o produktach finansowych umożliwiającą skuteczne modelowanie źródła kapitału w tym antycypowanie możliwych konsekwencji decyzji w zakresie doboru portfela finansowego rozłożonego w czasie (modelowanie wielowymiarowe) oraz modelowania biznesowych scenariuszy procesów finansowych z uwzględnieniem kapitału podwyższonego ryzyka, a także dobór klasycznych i alternatywnych źródeł finansowania (w tym modelowania przy zastosowaniu funkcji VBA)

## Tematyka zajęć

1. Wprowadzenie do modelowania finansowego - przypomnienie podstaw ekonomii, finansów i finansów przedsiębiorstw
2. Rola i znaczenie analizy procesów finansowych w modelu biznesowym - źródła finansowania i kryteria podziału kapitału w przedsiębiorstwie
3. Tożsamość prawna przedsiębiorstwa jako determinanta: pozyskiwania źródła finansowania i rozwoju biznesu

4. Skuteczne sygnały analizy technicznej w procesie modelowania finansowego
5. Biznesowe aspekty modelowania procesów finansowych - kapitał podwyższonego ryzyka oraz dobór klasycznych i alternatywnych źródeł finansowania
6. Modelowanie finansowe a analiza wrażliwości ze zmienną liczbą danych
7. Konstrukcja harmonogramów spłat zobowiązań finansowych

## Metody dydaktyczne

- I. PODAJĄCE: 1. Wykład informacyjny 2. Wykład problemowy 3. Wykład konwersacyjny
4. Pogadanka 5. Prelekcja, odczyt
- II. POSZUKUJĄCE: 1. Case study 2. Burza mózgów 3. Dyskusja - okrągłego stołu 4. Dyskusja - piramidowa 5. Dyskusja - seminaryjna 6. Dyskusja - referatowa
- III. ĆWICZENIOWO - PRAKTYCZNE: 1. Ćwiczenia audytoryjne 2. Metoda demonstracji 3. Metoda projektu 4. Metoda warsztatowa
- IV. EKSPONUJĄCE: 1. Pokaz (film)

## Literatura

### Podstawowa:

1. Małecka, J. (2021). Alternatywne źródła finansowania w zarządzaniu finansami mikro, małych i średnich przedsiębiorstw - Cechy przedsiębiorcy a wybór źródeł finansowania. Poznań: PTE.
2. Małecka, J. (2020). Instrumenty rynku kapitałowego w zarządzaniu finansami mikro, małych i średnich przedsiębiorstw - Cechy przedsiębiorstwa a wybór źródeł finansowania. Poznań: PTE
3. Goldratt, E.M., Cox, J. (2008). CEL I. Doskonałość w produkcji. Wydawnictwo: Mint Books - dostępne dla Studentów również w wersji pdf
4. Małecka, J. (2018). Alternative Sources of Financing for SMEs in Poland in the Light of Empirical Research. Proceedings, Volume 2, EFERIC 2018. The 2nd Entrepreneurship and Family Enterprise Research International Conference. - dostępne dla Studentów online: <https://doi.org/10.3390/proceedings2241521> <https://www.mdpi.com/2504-3900/2/24>

### Uzupełniająca:

1. Małecka, J. (2023). Financial motivational factors supporting the optimisation process. Journal of Intercultural Management Vol. 15 (3) 2023. DOI: 10.2478/joim-2023-0012.
2. Małecka, J. (2017). Alternative Securities Markets as Financing Sources for SMEs - Selected Aspects of AIM and NC. Contemporary Issues in Business, Management and Education 2017, 1-9 <http://doi.org/10.3846/cbme.2017.072>
3. Małecka, J. (2016). Alternative Securities Markets in Poland and the United Kingdom. Problemy Zarządzania vol.14, nr 4(63),t.1,pp:11-24. <http://dx.doi.org/10.7172/1644-9584.63.1> WOS: 000400572200001
4. Małecka, J. (2015). Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie jako potencjalne źródło finansowania małych i średnich przedsiębiorstw. ZN NR 848 Ekonomiczne Problemy Usług nr 116. P.496-507. Szczecin: Wydawnictwo Uniwersytetu Szczecińskiego. [http://www.wzieu.pl/zn/848/ZN\\_848.pdf](http://www.wzieu.pl/zn/848/ZN_848.pdf)
5. Doman, M. Doman, R. (2009). Modelowanie zmienności i ryzyka. Metody ekonometrii finansowej. Wolters Kluwer
6. Bieniasz A., Czerwińska-Kayzer D. (2004): Venture capital - źródło kapitału dla przedsiębiorstwa. W: Zarządzanie finansami. Finansowanie przedsiębiorstw w Unii Europejskiej. Red. D. Zarzecki. T. 1. Uniwersytet Szczeciński, Szczecin: 21-31.
7. Wolak-Tuzimek A. (2004): Alternatywne źródła finansowania działalności przedsiębiorstw. W: Zarządzanie finansami. Finansowanie przedsiębiorstw w Unii Europejskiej. Red. D. Zarzecki. T. 1. Uniwersytet Szczeciński, Szczecin: 163-173.
8. Okręglińska M. (2004): Aspekty prawne, organizacyjne i ekonomiczne leasingu. Difin, Warszawa
9. Tamowicz P., Rot P. (2002): Fundusze venture capital w Polsce - informator. Polska Agencja Rozwoju Przedsiębiorczości, Warszawa
10. Europejski Etyczny Kodeks Franchisingu. (1990). Europejska Federacja Franchisingu. <http://www.franchising.info.pl>.

## Bilans nakładu pracy przeciętnego studenta

	Godzin	ECTS
Łączny nakład pracy	30	1,00
Zajęcia wymagające bezpośredniego kontaktu z nauczycielem	20	0,50
Praca własna studenta (studia literaturowe, przygotowanie do zajęć laboratoryjnych/ćwiczeń, przygotowanie do kolokwίων/egzaminu, wykonanie projektu)	10	0,50