

KARTA PRZEDMIOTU

Nazwa przedmiotu: Rynki i instrumenty finansowe (ZAMS4-ZFP-RIF)

Nazwa w języku polskim:

Nazwa w jęz. angielskim:

Dane dotyczące przedmiotu:

Jednostka oferująca przedmiot: Wydział Nauk Społecznych i Humanistycznych

Przedmiot dla jednostki: Wydział Nauk Społecznych i Humanistycznych

Cykl dydaktyczny: Semestr letni 2020/2021

Koordinator przedmiotu cyklu:

Domyślny typ protokołu dla przedmiotu:

Egzamin

Skrócony opis:

Przedmiot przedstawia ogólną charakterystykę i klasyfikację rynków finansowych. Uczestnicy poznają uczestników rynku finansowego oraz jego segmenty. Uwaga skupiona jest na instrumentach rynku pieniężnego oraz banku centralnym jako najważniejszym podmiocie rynku i jego instrumentach. Omawiane są również rynek depozytowo-kredytowy, walutowy, kapitałowy – ich uczestnicy oraz instrumenty. Przedmiot należy do grupy zajęć obowiązkowych.

Opis:

Cele przedmiotu:

- zapoznanie studentów podstawowymi prawidłowościami związanymi z dynamiką rynków finansowych (w wymiarze globalnym i krajowym), przekazanie wiedzy o funkcjach rynku finansowego (w skali mikro i makroekonomicznej) oraz roli instytucji na nim funkcjonujących,
- uzyskanie wiedzy o mechanizmach rządzących przepływami kapitałowymi pomiędzy segmentami rynku finansowego i korelacji cen instrumentów finansowych (stopy procentowe-kursy walutowe-ceny papierów wartościowych)
- zrozumienie celu, zadań i narzędzi regulowania krajowego rynku finansowego,
- zrozumienie procedur związanych z dopuszczeniem akcji do obrotu giełdowego,
- zrozumienie istoty kryzysu finansowego.

Literatura:

Literatura podstawowa:

- 1.Al-Kaber M., Rynki finansowe, PWSZ w Suwałkach, Suwałki 2012.
- 2.Kudła J., Instrumenty finansowe i ich zastosowanie, Key Text, Warszawa 2009.
- 3.Czekaj J. (red.), Rynki, instrumenty i instrumenty finansowe, PWN, Warszawa 2008.

Literatura uzupełniająca:

- 1.Dębski W., Rynek finansowy i jego mechanizmy, PWN, Warszawa 2001.
- 2.Przybylska-Kapuscińska W.(red.), Funkcjonowanie współczesnego rynku pieniężnego i kapitałowego, CeDeWu, Warszawa 2013 (fragmenty udostępniane przez prowadzącego).

Efekty kształcenia:

- 1_W ma pogłębioną wiedzę o mechanizmie funkcjonowania rynku finansowego K_W02
- 2_W ma pogłębioną wiedzę o uwarunkowaniach prawnych funkcjonowania instytucji działających na rynku finansowym K_W03
- 3_W posiada pogłębioną wiedzę o inwestycjach instytucji finansowych na rynku pieniężnym i kapitałowym K_W07
- 4_W posiada wiedzę o emisji papierów wartościowych w celu pozyskania kapitałów na rozwój przedsiębiorstw K_W08
- 1_U potrafi podejmować decyzje inwestycyjne w papiery wartościowe na podstawie analizy fundamentalnej i technicznej K_U02, K_K05
- 2_U potrafi dokonać krytycznej oceny strategii inwestycyjnej K_U03
- 3_U potrafi kierować pracą zespołu podejmującego decyzje inwestycyjne K_U08
- 4_U potrafi planować proces uczenia się na skutek zmian zachodzących na rynku finansowym K_U09
- 1_K potrafi skutecznie uzasadniać proponowane rozwiązania w zakresie inwestycji na rynku finansowym K_K02
- 2_K potrafi określać priorytety służące realizacji określonego zadania inwestycyjnego K_K03

USOSweb: Szczegóły przedmiotu: ZAMS4-ZFP-RIF, w cyklu: 20/21L, jednostka dawcy: <brak>, grupa przedm.: <brak>

3_K rozstrzyga dylematy w procesie zarządzania instytucjami finansowymi K_K04

4_K postępuje etycznie przy podejmowaniu decyzji inwestycyjnych oraz w procesie zarządzania instytucją finansową K_K06

Metody i kryteria oceniania:

Udział oceny z danej formy zajęć w ocenie końcowej z przedmiotu:
ćwiczenia 100%

Sposoby weryfikacji efektów uczenia się

kolokwium 1_W, 2_W, 3_W, 4_W
aktywność na zajęciach 1_U, 2_U, 1_K, 2_K
dyskusja 3_U, 4_U, 1_K, 3_K, 4_K

Wskaźniki ilościowe

Nakład pracy studenta związany z zajęciami:

1.Liczba godzin realizowanych przy bezpośrednim udziale nauczyciela akademickiego:

-udział w ćwiczeniach- 45 godz.

-udział w egzaminie (w tym w egzaminie w sesji poprawkowej) - 4 godz.

Razem liczba godzin: 49; punkty ECTS 1,96

2.Liczba godzin niewymagających bezpośredniego udziału nauczyciela:

-przygotowanie do ćwiczeń- 31 godz.

-przygotowanie do egzaminu- 20 godz.

Razem liczba godzin: 51; punkty ECTS 2,04

ŁĄCZNA LICZBA GODZIN (kontaktowych i niekontaktowych): 100

Punkty ECTS za przedmiot: 4

Dane dotyczące przedmiotu cyklu:

Domyślny typ protokołu dla przedmiotu cyklu:

Egzamin

Szczegóły zajęć i grup

Wykład (30 godzin)

Dane grup zajęciowych

brak szczegółowych danych o grupach zajęciowych

Ćwiczenia (15 godzin)

Metody i kryteria oceniania:

kolokwium (80%), aktywność na zajęciach (20%).

Zakres tematów zajęć:

1.Architektura rynków finansowych. Rynek finansowy jako układ hierarchicznie zorganizowany. Segmenty rynku finansowego – interakcje i „efekt dopełniania się” pod względem funkcjonalnym. Niestabilność na współczesnych rynkach finansowych.

2.Stopa procentowa jako parametr rynku finansowego: istota stopy procentowej, zmiany stopy procentowej i inflacja, efekt Fishera, przewidywania stopy procentowej.

3.Struktura i funkcje rynku pieniężnego. Szczególna rola rynku międzybankowego w kształtowaniu płynności finansowej systemie finansowym. Instrumenty rynku pieniężnego.

4.Bank centralny i instrumenty polityki monetarnej. Rola NBP na rynku pieniężnym. Mechanizm transmisji impulsów polityki pieniężnej.

5.Rynek walutowy i reguły jego funkcjonowania. Rynek kasowy i rynek transakcji terminowych. Dynamika obrotów na rynku walutowym. Pozycja walutowa i pozycja płynności uczestników transakcji na rynku walutowym.

6.Czynniki wpływające na kursy walutowe. Rozwój rynku walutowego w Polsce. Euro jako waluta międzynarodowa.

7.Rynek kapitałowy a giełda papierów wartościowych. Dwoista natura giełdy. Giełda jako przykład rynku wysoce zorganizowanego.

8. Budowanie strategii inwestycyjnych na rynku giełdowym. Sekwencja w procesie inwestycyjnym inwestora giełdowego. Analiza fundamentalna i techniczna: założenia, elementy, narzędzia.

9. Inwestowanie w akcje: rodzaje akcji i prawa z nich wynikające, wycena akcji. Praktyczne zastosowanie analizy fundamentalnej i technicznej akcji wybranych spółek.

10. Funkcjonowanie rynku obligacji. Rynek obligacji skarbowych i przedsiębiorstw. Zawartość informacyjna cen obligacji i ich rentowności.

11. Wartość pieniądza w czasie. Wycena obligacji. Ryzyko inwestycji w obligacje

12. Rynek instrumentów pochodnych. Istota i zastosowanie inżynierii finansowej. Systematyka instrumentów pochodnych i ich funkcje. Determinanty cen instrumentów pochodnych i ich funkcja informacyjna.

13. Inwestorzy instytucjonalni na rynku finansowym:

- banki na rynku papierów wartościowych,
- spółdzielcze kasy oszczędnościowo-kredytowe i zasady ich funkcjonowania,
- instytucje niebankowe świadczące usługi finansowe,
- funkcjonowanie funduszy inwestycyjnych,
- fundusze typu private equity/venture capital,
- firmy ubezpieczeniowe,
- polityka inwestycyjna OFE i PPK.

Metody dydaktyczne:

prezentacje multimedialne, z elementami aktywizacji studentów (np. dyskusja), samodzielne i w grupach rozwiązywanie zadań wyceny instrumentów finansowych.

Dane grup zajęciowych

brak szczegółowych danych o grupach zajęciowych

Przynależność do grup przedmiotów w cyklach:

Opis grupy przedmiotów	Cykl pocz.	Cykl kon.
Przedmioty na zarządzaniu II stopnia stacjonarnym semestr 4 (P-ZA-MS-S4)	20/21L	
Przedmioty na zarządzaniu II stopnia stacjonarnym semestr 4 (ZA-MS-S4)	20/21L	

Punkty przedmiotu w cyklach:

<bez przypisanego programu>			
Typ punktów	Liczba	Cykl pocz.	Cykl kon.
ECTS (ECTS)	4	20/21L	