

Rynek giełdowy - opis przedmiotu

Informacje ogólne	
Nazwa przedmiotu	Rynek giełdowy
Kod przedmiotu	14.3-WZ-ZarzP-RG
Wydział	Wydział Ekonomii i Zarządzania
Kierunek	Zarządzanie
Profil	ogólnoakademicki
Rodzaj studiów	pierwszego stopnia z tyt. licencjata
Semestr rozpoczęcia	semestr zimowy 2018/2019

Informacje o przedmiocie	
Semestr	5
Liczba punktów ECTS do zdobycia	1
Typ przedmiotu	obowiązkowy
Język nauczania	polski
Sylabus opracował	dr Zbigniew Binek

Formy zajęć					
Forma zajęć	Liczba godzin w semestrze (stacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (stacjonarne)	Liczba godzin w semestrze (niestacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (niestacjonarne)	Forma zaliczenia
Wykład	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę
Laboratorium	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę

Cel przedmiotu

Celem przedmiotu jest nabycie przez studentów wiedzy, kompetencji i umiejętności z zakresu funkcjonowania rynku giełdowego.

Wymagania wstępne

Brak

Zakres tematyczny

Wykład:

1. Giełda – definicja, rodzaje, funkcje, cele, uczestnicy.
2. Inwestycje, inwestorzy i spekulanci.
3. Strategie inwestowania.
4. Zarys rynku giełdowego w Polsce, główne regulacje prawne. Komisja Nadzoru Finansowego, Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych, opodatkowanie zysków, domy maklerskie.
5. Giełda papierów wartościowych – organizacja giełdy i jej uczestnicy. Rodzaje zleceń giełdowych. Systemy ustalania kursów walorów. Papiery wartościowe – akcje, obligacje.
6. Rynek pochodnych instrumentów finansowych.
7. Forex – rynek walutowy.
8. Fundusze inwestycyjne.
9. Bezpieczeństwo na rynku giełdowym, stopa zwrotu z inwestycji.
10. Analiza fundamentalna i techniczna.
11. Analiza portfelowa. Model H. Markowitza, model W. Sharpe'a, inne modele.

Laboratorium:

1. Sesja giełdowa, systemy notowań, indeksy i wskaźniki. Przykłady.
2. Biura maklerskie: aktualne oferty.
3. Rodzaje i funkcje papierów wartościowych. Akcje, obligacje, prawa poboru, prawa do akcji (PDA). Przykłady.
4. Rynki pozagiełdowe: obligacji Skarbu Państwa, Catalyst, New Connect, Forex. Przykłady i zadania.
5. Spółka na giełdzie papierów wartościowych - korzyści, obowiązki i koszty. Dywidenda. Przykłady.
6. Zmiany cen i wskaźników giełdowych - obliczenia praktyczne.
7. Analiza fundamentalna i techniczna.
8. Ocena tradycyjnych i pochodnych instrumentów finansowych pod względem ryzyka, rentowności i płynności. Obliczanie rentowności nominalnej i realnej. Zadania i przykłady.
9. Dokonywanie transakcji na giełdzie. Przykłady i zadania.
10. Ocena efektywności lokowania kapitału w papiery wartościowe. Zadania i przykłady.
11. Strategie inwestowania na giełdzie.
12. Fundusze inwestycyjne. Przykłady i zadania.

13. Spekulacja giełdowa. Przykłady.
14. Przystępstwa, nadużycia występujące na GPW.

Metody kształcenia

Wykład konwencjonalny i problemowy, metoda przypadków. Laboratorium: praca w grupach, sprawozdania laboratoryjne, dyskusja, „burza mózgów”, „giełda pomysłów”, wirtualna gra giełdowa. Stworzony zostanie portfel inwestycyjny - na każdym ćwiczeniu (w grupach) nastąpi wirtualny zakup akcji na GPW w Warszawie. Wybór walorów będzie uzasadniony bieżącą i/lub przeszłą/przyszłą sytuacją spółki, notowaniami giełdowymi, rekomendacjami, informacjami napływającymi z rynku i od instytucji działających na rynku kapitałowym. Na bieżąco będzie komentowana sytuacja panująca na giełdzie papierów wartościowych i w poszczególnych spółkach.

Efekty uczenia się i metody weryfikacji osiągnięcia efektów uczenia się

Opis efektu	Symbole efektów	Metody weryfikacji	Forma zajęć
Student definiuje szereg pojęć z zakresu rynków finansowych i kapitałowych oraz identyfikuje uczestników tych rynków oraz zna instrumenty finansowe	• K_W04	• obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta • projekt • wykonanie sprawozdań laboratoryjnych • zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	• Wykład • Laboratorium
Student analizuje i rozwiązuje podstawowe problemy występujące na rynku giełdowym	• K_U03	• aktywność w trakcie zajęć • obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta • wykonanie sprawozdań laboratoryjnych • zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	• Laboratorium
Student prowadzi dyskusje w grupach, dotyczące przygotowanych wcześniej wspólnie z innymi studentami prezentacji	• K_K01	• aktywność w trakcie zajęć • obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta • przygotowanie referatu • wykonanie sprawozdań laboratoryjnych • zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	• Laboratorium

Warunki zaliczenia

Warunkiem zaliczenia laboratorium jest opracowanie i przedstawienie w grupach prezentacji na wybrany temat związany z rynkiem giełdowym przy wykorzystaniu podstawowych zagadnień teoretycznych przedstawionych na wykładzie oraz przykładów praktycznych. Liczbę uzyskanych punktów członkowie grupy dzielą sami zgodnie z indywidualnym wkładem pracy do prezentacji. Na wszystkich zajęciach laboratoryjnych odbywać się będzie wirtualna gra na GPW. Ocena z ćwiczeń będzie w 50% zależała od otrzymanych punktów za przygotowaną prezentację i w 50% z aktywności na poszczególnych zajęciach.

Warunkiem zaliczenia wykładów jest pozytywne zaliczenie w formie ustnej składającej się z pięciu pytań (od 50% do 60% dostateczny; powyżej 60% do 70% dostateczny plus; powyżej 70% do 80% dobry; powyżej 80% do 90% dobry plus, powyżej 90% bardzo dobry). Na ocenę końcową składa się ocena z wykładu (50%) i ocena z ćwiczeń (50%).

Literatura podstawowa

1. Becket M., *Jak działa giełda*, K. E. Liber, Warszawa 2012.
2. Czekaj J. (red.), *Rynki, instrumenty i instytucje finansowe*, PWN, Warszawa 2008.
3. Jajuga K., *Giełdowe instrumenty pochodne*, Wyd. GPW, Warszawa 2010.
4. Jajuga K., Jajuga T., *Inwestycje. Instrumenty. Aktywa niefinansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa*, PWN, Warszawa 2008.
5. Jajuga K., *Podstawy inwestowania na Giełdzie Papierów Wartościowych*, Wyd. GPW, Warszawa 2010.
6. Strona internetowa GPW w Warszawie.

Literatura uzupełniająca

1. Antkiewicz S., *Papiery wartościowe na rynku pieniężnym i kapitałowym*, Wydawnictwo Cedewu.pl, Warszawa 2012.
2. Kulpaka P., *Giełdy w gospodarce*, PWE, Warszawa 2007.
3. Maliński T., *Giełda Papierów Wartościowych dla bystrzaków*, Helion, Gliwice 2015.
4. Zaremba A., *Giełda. Podstawy inwestowania*, Helion, Gliwice 2014.

Uwagi

Zmodyfikowane przez dr Zbigniew Binek (ostatnia modyfikacja: 28-05-2018 09:17)