

# Rynek giełdowy - opis przedmiotu

Informacje ogólne	
Nazwa przedmiotu	Rynek giełdowy
Kod przedmiotu	14.3-WZ-ZarzP-RG
Wydział	<a href="#">Wydział Ekonomii i Zarządzania</a>
Kierunek	Zarządzanie
Profil	ogólnoakademicki
Rodzaj studiów	pierwszego stopnia z tyt. licencjata
Semestr rozpoczęcia	semestr zimowy 2019/2020

Informacje o przedmiocie	
Semestr	5
Liczba punktów ECTS do zdobycia	2
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. Przesłębstwa, 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 laboratorium (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	• <a href="#">K_W04</a>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta</li> <li>• projekt</li> <li>• wykonanie sprawozdań laboratoryjnych</li> <li>• zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Wykład</li> <li>• Laboratorium</li> </ul>
Student analizuje i rozwiązuje podstawowe problemy występujące na rynku giełdowym	• <a href="#">K_U03</a>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• aktywność w trakcie zajęć</li> <li>• obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta</li> <li>• wykonanie sprawozdań laboratoryjnych</li> <li>• zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Laboratorium</li> </ul>
Student prowadzi dyskusje w grupach, dotyczące przygotowanych wcześniej wspólnie z innymi studentami prezentacji	• <a href="#">K_K01</a>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• aktywność w trakcie zajęć</li> <li>• obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta</li> <li>• przygotowanie referatu</li> <li>• wykonanie sprawozdań laboratoryjnych</li> <li>• zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Laboratorium</li> </ul>

## 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 laboratorium 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 laboratorium (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 Paweł Szudra (ostatnia modyfikacja: 01-05-2019 00:39)