

Rynki kapitałowe - opis przedmiotu

Informacje ogólne	
Nazwa przedmiotu	Rynki kapitałowe
Kod przedmiotu	14.3-WZ-LogP-RK
Wydział	Wydział Ekonomii i Zarządzania
Kierunek	Logistyka
Profil	praktyczny
Rodzaj studiów	pierwszego stopnia z tyt. inżyniera
Semestr rozpoczęcia	semestr zimowy 2023/2024

Informacje o przedmiocie	
Semestr	6
Liczba punktów ECTS do zdobycia	2
Typ przedmiotu	obieralny
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	30	2	18	1,2	Zaliczenie na ocenę

Cel przedmiotu

Celem przedmiotu jest nabycie przez studentów wiedzy, kompetencji i umiejętności z zakresu funkcjonowania rynków kapitałowych oraz zapoznanie z praktycznymi instrumentami zabezpieczającymi i spekulacyjnymi stosowanymi na tych rynkach. Kluczowym celem jest nabycie przez studentów praktycznej wiedzy i umiejętności inwestowania na Giełdzie Papierów Wartościowych.

Wymagania wstępne

Brak.

Zakres tematyczny

Wykłady

1. Wprowadzenie do przedmiotu, zaznajomienie z programem wykładów i strukturą zajęć, zapoznanie z dostępną literaturą związaną z omawianymi zagadnieniami, ogólny zarys problematyki przedmiotu.
2. Rynek finansowy w gospodarce rynkowej. Relacje między konkurencją i regulacją na rynku finansowym – różne koncepcje i rozwiązania praktyczne.
3. Istota kapitału, zmiana wartości pieniądza w czasie.
4. Giełda Papierów Wartościowych. Rodzaje akcji i obligacji. Uczestnicy rynku. Ocena ryzyka różnych instrumentów rynku kapitałowego. Fundusze inwestycyjne. Inwestycje, inwestorzy i spekulanci. Strategie inwestowania.
5. System bankowy, podstawy bankowości, czynności bankowe.
6. Rynek walutowy. Międzynarodowy system walutowy. Waluty lokalne.
7. Rynek pochodnych instrumentów finansowych – kontrakty terminowe forward i futures, opcje, kontrakt swap.
8. Proces wprowadzania waluty euro. Mechanizmy funkcjonowania strefy euro.
9. Przepływy kapitału w formie bezpośrednich inwestycji zagranicznych i inwestycji portfelowych - szanse i zagrożenia dla uczestników rynku.
10. Kryzysy finansowe - przyczyny i skutki powstawania oraz sposoby zapobiegania im.

Laboratorium

1. Wprowadzenie do przedmiotu, zaznajomienie z programem laboratorium i strukturą zajęć, zapoznanie z dostępną literaturą związaną z omawianymi zagadnieniami, ogólny zarys problematyki przedmiotu.
2. Rynek finansowy – funkcje, instytucje, cechy, instrumenty: przykłady.
3. Rynek kapitałowy – funkcje, instytucje, cechy, instrumenty: przykłady.
4. Rynek pieniężny – funkcje, instytucje, cechy, instrumenty: przykłady.
5. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Azji. Przykłady.
6. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Afryce. Przykłady.
7. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Ameryce Północnej. Przykłady.
8. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Ameryce Południowej. Przykłady.
9. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Europie. Przykłady.
10. Problemy rozwoju i funkcjonowania rynków finansowych i kapitałowych w Australii. Przykłady.
11. Przepływy kapitału w formie bezpośrednich inwestycji zagranicznych i inwestycji portfelowych - szanse i zagrożenia dla uczestników rynku: przykłady.

12. Tradycyjne i nowe instrumenty rynku kapitałowego – przykłady.
13. Fundusze inwestycyjne i emerytalne: case study.
14. System ubezpieczeniowy – funkcje, instytucje i cechy rynku ubezpieczeń. Rodzaje ubezpieczeń.
15. Bezpieczeństwo na rynku finansowym. Nadzór nad sektorem bankowym, ubezpieczeniowym i giełdowym – różne rozwiązania nadzoru finansowego.
16. Przestępczość na rynku finansowym – case study.
17. Kryptowaluty. NFT.
18. Konglomeraty finansowe – łączenie różnych segmentów rynku finansowego: przykłady.
19. Kryzysy finansowe – case study.
20. Agencje ratingowe – przykłady.
21. Zadłużenie międzynarodowe – analiza danych statystycznych.
22. Główne centra finansowe świata.
23. Międzynarodowe instytucje finansowe.

Metody kształcenia

Wykład konwencjonalny i problemowy, metoda przypadków.

Laboratorium: praca w grupach, przedstawianie przygotowanych wcześniej prezentacji tematycznych, dyskusja, „burza mózgów”, „giełda pomysłów”. Stworzony zostanie indywidualny portfel inwestycyjny (wirtualny zakup akcji na GPW w Warszawie, walut i innych instrumentów na rynku kapitałowym) - na każdych laboratoriach każdy student będzie omawiał zmiany zachodzące w jego portfelu. Wybór walorów będzie uzasadniony analizą fundamentalną, analizą techniczną, 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 potrafi dobierać i stosować odpowiednie aplikacje komputerowe do obliczeń, symulacji, projektowania i weryfikacji rozwiązań zależności zmiennych finansowych	K_U06	projekt	Laboratorium
Student definiuje szereg pojęć z zakresu rynków finansowych i kapitałowych oraz identyfikuje uczestników tych rynków oraz zna instrumenty finansowe	K_W10 K_W11	- projekt - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	- Wykład - Laboratorium
Student charakteryzuje różne rodzaje instrumentów finansowych oraz instytucje zaangażowane w sektor rynku finansowego	K_W11	- projekt - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	- Wykład - Laboratorium
Student prowadzi dyskusje w grupach, dotyczące przygotowanych wcześniej wspólnie z innymi studentami prezentacji	K_U01 K_U03 K_U07	- aktywność w trakcie zajęć - dyskusja - odpowiedź ustna - przygotowanie referatu - referat	Laboratorium
Student dokonuje krytycznej oceny posiadanej wiedzy oraz uznaje znaczenie wiedzy w rozwiązywaniu problemów poznawczych i praktycznych ukierunkowanych na logistykę	K_U08 K_K01	- aktywność w trakcie zajęć - projekt	Laboratorium
Student posiada umiejętność prezentowania własnych koncepcji i prognozowania praktycznych skutków dotyczących zmian w organizacji, wykorzystuje zdobytą wiedzę (z zakresu ekonomii, finansów, zarządzania, towaroznawstwa i innych) przy podejmowaniu decyzji	K_U04 K_K01	- aktywność w trakcie zajęć - obserwacje i ocena umiejętności praktycznych studenta - projekt	Laboratorium
Student potrafi pozyskiwać informacje nt. rynków kapitałowych, trendów, czynników wpływających na rynki kapitałowe z literatury, baz danych oraz innych źródeł, integrować je, dokonywać ich interpretacji oraz wyciągać wnioski i formułować opinie, także w języku angielskim	K_U01	- aktywność w trakcie zajęć - odpowiedź ustna - projekt - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	- Wykład - Laboratorium
Student zna standardowe metody matematyczne, ekonometryczne, statystyczne i narzędzia informatyczne, analizy i prezentacji danych, właściwe dla oceny tendencji na rynku kapitałowym	K_W12	- projekt - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	- Wykład - Laboratorium

Warunki zaliczenia

Warunkiem zaliczenia wykładów jest pozytywne zaliczenie w formie ustnej.

Warunkiem zaliczenia laboratorium jest opracowanie i przedstawienie w grupach prezentacji na wybrany temat związany z rynkiem kapitałowym 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. Dodatkowo, na ocenę z laboratorium wpływ ma aktywność na zajęciach (także w trakcie prezentowania stworzonych portfeli inwestycyjnych).

Literatura podstawowa

Czekaj J. (red.), *Rynki, instrumenty i instytucje finansowe*, PWN, Warszawa 2013.

Jajuga K. (red.), *Inwestycje – instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa*, PWN, Warszawa 2011.

Jaworski W., Zawadzka Z., (red.), *Bankowość*, Poltext, Warszawa 2011.

Nawrot W., *Rynek kapitałowy i jego rozwój*, CeDeWu, Warszawa 2008.

Ostrowska E., *Rynek kapitałowy*, PWE, Warszawa 2007.

Pietrzak E., Markiewicz M. (red.), *Finanse, bankowość i rynki finansowe*, Wydawnictwo Uniwersytetu Gdańskiego, Gdańsk 2009.

Sławiński A., *Rynki finansowe*, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2006.

Thiel S., *Rynek kapitałowy i terminowy*, KNF, Warszawa 2010.

Strony internetowe o GPW: <https://www.gpw.pl> <https://gragiieldowa.pl> <https://www.biznesradar.pl>

Literatura uzupełniająca

Antkiewicz S., *Papiery wartościowe na rynku pieniężnym i kapitałowym*, Wydawnictwo Cedewu.pl, Warszawa 2012.

Bednarczyk J., Bukowski S., Misala J., (red.), *Globalne rynki finansowe w dobie kryzysu*, Wyd. CeDeWu, Warszawa 2009.

Binek Z., *Bezpośrednie inwestycje zagraniczne a wprowadzenie euro w Polsce*, Wydawnictwo Uniwersytetu Zielonogórskiego, Zielona Góra 2009.

Chorafas Dimitris N. (1994): *Chaos Theory in the Financial Markets*, Probus Publishing Company, Chicago.

Chrabonszczewska E., Oręziak L., *Międzynarodowe rynki finansowe*, SGH, Warszawa 2000.

Dębski W., *Rynek finansowy i jego mechanizmy*, PWN, Warszawa 2010.

Dmowski A., Prokopowicz D., *Rynki finansowe*, Wyd. Difin, Warszawa 2010.

Jajuga K., *Podstawy inwestowania na Giełdzie Papierów Wartościowych*, Wyd. GPW, Warszawa 2010.

Kazuń-Cieślak G., *Światowy rynek kapitału*, Difin, Warszawa 2011.

Marecki K. (red.), *Podstawy finansów*, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2008.

Piókarz R., *Globalne rynki finansowe*, PWN, Warszawa 2013.

Proniewski M., *Rynek pieniężny i kapitałowy. Podstawy teorii i praktyki*, Wyd. WSiFiZ, Białystok 2002

Zabielski K., *Finanse międzynarodowe*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2002.

Uwagi

Zmodyfikowane przez dr Zbigniew Binek (ostatnia modyfikacja: 23-05-2023 14:13)

Wygenerowano automatycznie z systemu SylabUZ