


KAPITAŁ LUDZKI
NARODOWA STRATEGIA SPÓJNOŚCI

 Projekt współfinansowany przez
Unię Europejską w ramach
Europejskiego Funduszu
Społecznego

UNIA EUROPEJSKA
EUROPEJSKI
FUNDUSZ SPOŁECZNY


Nazwa przedmiotu			Kod ECTS
Rynki finansowe			14.3.7220
Nazwa jednostki prowadzącej przedmiot			
Katedra Bankowości i Finansów			
Studia			
wydział	kierunek	poziom	pierwszego stopnia
Wydział Zarządzania	Finanse i rachunkowość	forma	niestacjonarne (zaoczne)
		moduł	Podstawowa
		specjalnościowy	wszystkie
specjalizacja			
Nazwisko osoby prowadzącej (osób prowadzących)			
dr Adam Barembruch; dr Andrzej Dżuryk; dr Katarzyna Welzant; dr Sławomir Kujawa			
Formy zajęć, sposób ich realizacji i przypisana im liczba godzin		Liczba punktów ECTS	
Formy zajęć		5	
Wykład, Ćw. audytoryjne		1,50 pkt ECTS (38 h) - Udział w zajęciach (wykład i ćwiczenia)	
Sposób realizacji zajęć		0,20 pkt ECTS (5 h) - Konsultacje z wykładowcą, zaliczenie	
zajęcia on-line, zajęcia w sali dydaktycznej		1,00 pkt ECTS (25 h) - Studiowanie literatury, przygotowywanie do zajęć	
Liczba godzin		1,00 pkt ECTS (25 h) - Projekt	
Wykład: 24 godz., Ćw. audytoryjne: 14 godz.		1,30 pkt ECTS (33 h) - Przygotowanie do zaliczenia ćwiczeń i egzaminu	
Termin realizacji przedmiotu			
2024/2025 zimowy			
Status przedmiotu		Język wykładowy	
obowiązkowy		polski	
Metody dydaktyczne		Forma i sposób zaliczenia oraz podstawowe kryteria oceny lub wymagania egzaminacyjne	
<ul style="list-style-type: none">- Dyskusja- Rozwiązywanie zadań- Wykład z prezentacją multimedialną		Sposób zaliczenia	
		<ul style="list-style-type: none">- Zaliczenie na ocenę- Egzamin	
		Formy zaliczenia	
		<ul style="list-style-type: none">- wykonanie pracy zaliczeniowej - projekt lub prezentacja- egzamin pisemny testowy- kolokwium	
		Podstawowe kryteria oceny	
		Ćwiczenia: (min 51%)	
		Standardowy rozkład punktów:	
		40% - Projekt	
		60% - Kolokwium	
		Projekt może polegać na przygotowaniu analizy, prezentacji lub polegać na rozwiązywaniu testów częściowych lub zadań problemowych. Szczegółowe warunki projektu wyjaśnia Prowadzący zajęcia na początku semestru.	
		Kolokwium ma formę pisemną (test i/lub pytania otwarte, zadania).	
		Wykład: (min 51%)	
		100% - Egzamin pisemny testowy z zadaniami	
Sposób weryfikacji założonych efektów uczenia się			

	Ćwiczenia		Wykład
Wiedza	Projekt	Kolokwium	Egzamin
FiR1 W02	X	X	X
FiR1 W07	X	X	X
FiR1 W09	X	X	X
Umiejętności			
FiR1 U01	X	X	X
FiR1 U02	X	X	X
FiR1 U06	X	X	X
Kompetencje			
FiR1 K03	X	X	X
FiR1 K04	X	X	X
FiR1 K05	X	X	X

Określenie przedmiotów wprowadzających wraz z wymogami wstępnymi**A. Wymagania formalne**

brak

B. Wymagania wstępne

brak

Cele kształcenia

Zapoznanie studentów z teoretycznymi i praktycznymi aspektami funkcjonowania rynku finansowego

Treści programowe**Wykład**

Wprowadzenie do rynków finansowych

Istota i podział rynków w gospodarce, sposoby ustalania cen na rynkach (oferta, negocjacje, aukcja i przetarg), pojęcie, klasyfikacje i funkcje rynków finansowych, struktura rynków finansowych, istota, cechy i klasyfikacje papierów wartościowych i instrumentów finansowych.

Asymetria informacji i regulacje i instytucje finansowe

Asymetria informacji na rynku finansowym i jej skutki, hazard moralny a phishing, przykłady hazardu moralnego na rynku finansowym, hazard moralny a ryzyko systemowe, regulacje ostrożnościowe na rynku finansowym, system nadzoru nad rynkiem finansowym, nadzór finansowy w Polsce i UE. Instytucje finansowe na rynku finansowym, fundusze inwestycyjne - zasady funkcjonowania, fundusze emerytalne - funkcje, zasady działania.

Rynek pieniężny

Pojęcie, segmenty i instrumenty rynku pieniężnego, stopy procentowe, procenty, punkty procentowe i punkty bazowe, instrumenty rynku pieniężnego i ich specyfika, elementy wyceny instrumentów rynku pieniężnego, polityka pieniężna, instrumenty polityki pieniężnej NBP i RPP (rezerwa obowiązkowa, operacje repo i reverse repo, bazowe stopy procentowe (depozytowa, referencyjna i lombardowa), polityka kursu walutowego), przetargi na bony pieniężne, inflacja, deflacja, aprecjacja, deprecjacja, kwotowania na rynku pieniężnym (bid i offer), stawki referencyjne i sposoby ich ustalania, manipulacje stawkami referencyjnymi (LIBOR).

Rynek walutowy

Pojęcie, segmenty i cechy rynku walutowego, instrumenty rynku walutowego, waluty obce a dewizy, kurs walutowy i pojęcia z nim związane, rodzaje kwotowań, transakcje walutowe i kursy krzyżowe, kurs terminowy i teorie kursu walutowego, rynek forex i kryptowaluty, modele działania brokerów na rynku forex, platformy transakcyjne.

Rynek kapitałowy - Instrumenty i funkcjonowanie

Pojęcie, cechy rynku kapitałowego, instrumenty rynku kapitałowego i ich charakterystyka i elementy wyceny, funkcjonowanie GPW, indeksy giełdowe i ich specyfika, system zorganizowanego obrotu instrumentami finansowymi, rodzaje i realizacja zleceń giełdowych, rachunki maklerskie, opodatkowanie zysków kapitałowych.

Rynek kapitałowy - Strategie inwestycyjne

Proste i złożone strategie inwestycyjne, inwestowanie na rynku kapitałowy jako proces, proste strategie inwestycyjne oparte na systematycznym inwestowaniu, złożone strategie inwestycyjne (Analiza techniczna, fundamentalna, portfelowa).

Rynek instrumentów pochodnych

Pojęcie i funkcje instrumentów pochodnych, klasyfikacja instrumentów pochodnych, instrumenty symetryczne i niesymetryczne – specyfika, elementy wyceny, zastosowanie, strategie opcyjne, zasady konstrukcji transakcji swapowej.

Ćwiczenia

Rynek pieniężny

Analiza i elementy wyceny instrumentów rynku pieniężnego, instrumenty polityki pieniężnej NBP, inflacja, deflacja, aprecjacja, deprecjacja, kwotowania na rynku pieniężnym, stawki referencyjne.

Rynek walutowy

Kurs walutowy, rodzaje kwotowań, transakcje walutowe i kursy krzyżowe, kurs terminowy i teorie kursu walutowego, kursy krzyżowe, rynek forex i kryptowaluty.

Rynek kapitałowy

Instrumenty rynku kapitałowego i elementy ich wyceny, indeksy giełdowe i ich specyfika, rodzaje i realizacja zleceń giełdowych, rachunki maklerskie, opodatkowanie zysków kapitałowych, strategie inwestycyjne, elementy analizy technicznej, fundamentalnej i portfelowej.

Rynek instrumentów pochodnych

Instrumenty symetryczne i niesymetryczne – specyfika, elementy wyceny, zastosowanie.

Wykaz literatury**A.1. wykorzystywana podczas zajęć**

Czekaj J. (red.), (2017), Rynki, instrumenty i instytucje finansowe, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa

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

A.2. studiowana samodzielnie przez studenta

Broszkiewicz M., Pauka M., (2019), Podstawy rynku finansowego. Przykłady i zadania., Wydawnictwo UE, Wrocław.

B. Literatura uzupełniająca

Barembuch, A. (2014). Alternatywne strategie oparte na systematycznym inwestowaniu – ujęcie teoretyczne. Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego. Finanse. Rynki finansowe. Ubezpieczenia, (nr 65 Zarządzanie finansami w przedsiębiorstwach i jednostkach samorządu terytorialnego), 431–441.

Barembuch, A. (2011). Hazard moralny w działalności pośredników finansowych. Prace i Materiały Wydziału Zarządzania Uniwersytetu Gdańskiego, (nr 4/5), 293–302.

Dębski W., (2014), Rynek finansowy i jego mechanizmy: podstawy teorii i praktyki, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.

Sławiński A., (2006), Rynki finansowe, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa.

Sopoćko A., (2012), Rynkowe instrumenty finansowe, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.

Barembuch A., (2018), Zarządzanie finansami osobistymi. Teoria i praktyka. Wydawnictwo Uniwersytetu Gdańskiego, Gdańsk.

Kierunkowe efekty uczenia się**Wiedza**

FiR1_W02

FiR1_W07

FiR1_W09

Umiejętności

FiR1_U01

FiR1_U02

FiR1_U06

Kompetencje

FiR1_K03

FiR1_K04

FiR1_K05

Wiedza

FiR1_W02 Ma zaawansowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących, w szczególności o: systemie bankowym, ubezpieczeniowym, podatkowym, rynkach finansowych, organizacji systemu finansów publicznych oraz sektora prywatnego. Zna wzajemne relacje pomiędzy tymi strukturami i instytucjami społecznymi w skali krajowej i międzynarodowej.

FiR1_W07 Ma zaawansowaną wiedzę o normach i regulacjach (prawnych, organizacyjnych, moralnych i etycznych) w zakresie finansów i rachunkowości. Zna i rozumie pojęcia i zasady z zakresu ochrony własności przemysłowej i prawa autorskiego.

FiR1_W09 Zna zasady tworzenia i ekonomicznego funkcjonowania organizacji komercyjnych i sektora publicznego, ich formy, fazy rozwoju, jak również uwarunkowania finansowe determinujące ich wartość oraz sukces ekonomiczny.

Umiejętności

FiR1_U01 Rozumie i potrafi prawidłowo interpretować złożone zjawiska ekonomiczne w zakresie nauki o zarządzaniu i jakości. Rozumie i umie wyjaśnić treść komunikatów instytucji gospodarczych, artykułów zamieszczanych w prasie codziennej i czasopismach z zakresu finansów (z wyłączeniem czasopism naukowych). Prawidłowo stosuje pojęcia z zakresu nauk społecznych.

FiR1_U02 Potrafi pozyskiwać z różnych źródeł dane do analizowania konkretnych procesów i zjawisk ekonomicznych dotyczących finansów. Potrafi korzystać z technologii informacyjnych.

FiR1_U06 Wykorzystuje zdobytą wiedzę do rozstrzygania dylematów pojawiających się w pracy zawodowej. Potrafi rozwiązać zaawansowane problemy z zakresu finansów i rachunkowości pojawiające się w praktyce gospodarczej: porównać instrumenty finansowe, ocenić opłacalność przedsięwzięcia, ocenić sytuację finansową organizacji na tle sektora, zaproponować odpowiednie rozwiązania problemów z zakresu podatków, zidentyfikować i dobrać odpowiednie metody zarządzania ryzykiem, skonstruować program ochrony ubezpieczeniowej

przedsiębiorstwa, dobrać źródła finansowania organizacji, skonstruować odpowiedni system rachunkowości/controllingu.

Kompetencje społeczne (postawy)

FiR1_K03 Komunikacja potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie, odważnie (ale z rozważą) wyraża swoje zdanie, nie boi się zadawać pytań, potrafi kulturalnie uczestniczyć w dyskusji, umie wyrażać konstruktywną krytykę.

FiR1_K04 Uczciwość stosuje się do zasad etyki biznesu, szanuje prawo, jest obiektywny, potrafi dostrzec konflikt interesów, prawidłowo identyfikuje i rozstrzyga dylematy związane z wykonywaniem zawodu.

FiR1_K05 Odpowiedzialność dotrzymuje terminów, potrafi odpowiednio określić priorytety służące realizacji określonego przez siebie zadania, konsekwentnie dąży do celu, umie pracować systematycznie i samodzielnie stosuje się do reguł i norm życia społecznego.

Kontakt

adam.barembuch@ug.edu.pl