

Politechnika Krakowska im. Tadeusza Kościuszki

KARTA PRZEDMIOTU

Rynki i instrumenty finansowe <i>nazwa przedmiotu</i>
Financial markets and instruments <i>nazwa przedmiotu w języku angielskim</i>
polski <i>język wykładowy</i>
przedmioty ogólne <i>kategoria przedmiotu/grupa zajęć</i>

Cykl kształcenia rozpoczynający się od: rok akademicki 2025/2026, semestr I/II

Jednostka organizacyjna: Do ustalenia z opiekunem kierunku

Kierunek studiów: Do ustalenia z opiekunem kierunku

Specjalność: Do ustalenia z opiekunem kierunku

Profil studiów: ogólnoakademicki

Poziom studiów Do ustalenia z opiekunem kierunku

Forma studiów Do ustalenia z opiekunem kierunku

Wymagania wstępne:

1. Brak

Cele przedmiotu:

1. Zapoznanie studentów z funkcjonowaniem rynków finansowych oraz cech charakterystycznych poszczególnych instrumentów finansowych, w tym instrumentów rynku pieniężnego, kapitałowego i terminowego.
2. Wykształcenie umiejętności dokonywania właściwej oceny sytuacji rynkowej pod względem wykorzystania instrumentów finansowych do celów inwestycyjnych i zarządzania ryzykiem.
3. Wykształcenie postawy przedsiębiorczej pod względem przekazywania i wykorzystania wiedzy na temat rynków finansowych

Efekty uczenia się:

Kod efektu uczenia się	Opis efektu uczenia się	Kod kierunkowego efektu uczenia się
Wiedza Absolwent zna i rozumie:		
EW1	rolę rynku finansowego w strukturze społeczno-gospodarczej kraju	
EW2	strukturę i zasady funkcjonowania rynku finansowego w skali krajowej i międzynarodowej	
Umiejętności Absolwent potrafi:		
EU1	analizować i zinterpretować procesy (zjawiska) zachodzące na rynku finansowym, z uwzględnieniem dynamicznie zmieniającego się otoczenia zewnętrznego	
EU2	wykorzystać posiadaną wiedzę teoretyczną do prognozowania procesów na krajowym rynku finansowym, z uwzględnieniem jego powiązań z globalnym rynkiem finansowym	
Kompetencje społeczne Absolwent jest gotów do:		
EK1	podejmowania decyzji w sposób przedsiębiorczy, z uwzględnieniem ryzyka gospodarczego	

Forma zajęć, semestralna liczba godzin:

Semestr	Punkty ECTS	Forma zaliczenia (E/Z)	Wykłady (W)	Ćwiczenia (C)	Laboratoria (L)	Laboratoria komputerowe (LK)	Projekty (P)	Seminaria (S)	Praktyka zawodowa (PZ)
	2	Z	15	15					

E – egzamin; Z – zaliczenie

Treści programowe:

Lp.	Forma zajęć	Tematyka zajęć	Liczba godzin
1	w	Rynek finansowy w systemie społeczno-gospodarczym. Obszary rynku finansowego. Rynek pieniężny i kapitałowy. Rynek kasowy i terminowy	1
2	w	Regulacje rynku finansowego	1
3	w	Rynek pierwotny. Zasady emisji i sprzedaży papierów wartościowych subskrybentom	1
4	w	Wtórny rynek papierów wartościowych. Motywy zawierania transakcji na rynku wtórnym	1
5	w	Obligacja podstawowym instrumentem dłużnym rynku kapitałowego. Cena nominalna, emisyjna i rynkowa. Czynniki wpływające na wartość rynkową obligacji	1

6	w	Listy zastawne publiczne i hipoteczne. Zasady emisji i obrotu.	1
7	w	Krótkoterminowe papiery dłużne. Bony skarbowe, bankowe i komercyjne.	1
8	w	Akcja podstawowym instrumentem udziałowym rynku kapitałowego. Zasady emisji akcji, ich sprzedaży na rynku pierwotnym i wtórnym	1
9	w	Rodzaje akcji. Cena nominalna, emisyjna i rynkowa akcji. Czynniki wpływające na wartość rynkową akcji	1
10	w	Weksel, jego rola dla współczesnej gospodarki. Dyskonto i redyskonto weksla.	1
11	w	Certyfikaty inwestycyjne a jednostki uczestnictwa w funduszach powierniczych.	1
12	w	Rynek terminowy. Instrumenty pochodne (derywaty), instrumenty bazowe.	1
13	w	Instrumenty pochodne na rynku pozagiełdowym. Kontrakty forward, swap i opcje. Ryzyko zajętych pozycji.	1
14	w	Giełdowy obrót instrumentami pochodnymi. Kontrakty futures i kontrakty opcyjne. Rola izby rozliczeniowej w ograniczaniu ryzyka stron kontraktu.	1
15	w	Organizacja giełdy. „Byki” i „niedźwiedzie”. Ustalanie cen dla instrumentów giełdowych. Indeksy giełdowe.	1
16	ć	Rynek finansowy i jego obszary.	1
17	ć	Transakcje na rynku pierwotnym i wtórnym.	1
18	ć	Inwestorzy indywidualni i instytucjonalni.	1
19	ć	Tradycyjne papiery wartościowe.	1
20	ć	Obligacja i jej rodzaje. Ceny obligacji.	1
21	ć	Listy zastawne. Ryzyko inwestora.	1
22	ć	Bony i ich wycena przy sprzedaży na przetargach.	1
23	ć	Akcje, ich rodzaje i wycena.	1
24	ć	Znaczenie akcji dla emitenta, inwestora i gospodarki.	1
25	ć	Weksel prosty a trasowany.	1
26	ć	Wycena kontraktów forward i futures.	1
27	ć	Wymiana strumieni płatności w ramach kontraktu swap (procentowego i walutowego).	1
28	ć	Opcja wyjątkowym instrumentem rynku terminowego. Profil zysku dla wystawcy i nabywcy.	1
29	ć	Opcje standardowe i niestandardowe.	1
30	ć	Szacowanie cen kontraktów opcyjnych. Model Blacka-Scholesa.	1

Praca własna studenta:

Lp.	Opis pracy własnej	Liczba godzin
1	przygotowanie się do zajęć, w tym studiowanie zalecanej literatury	20
2	przygotowanie raportu z przeprowadzonych analiz, prezentacji	15
3	konsultacje przedmiotowe	5

Metody dydaktyczne:

Wykład, prezentacje, studia przypadków, dyskusje.

Metody i techniki kształcenia na odległość:

Istnieje możliwość prowadzenia zajęć zdalnie, z wykorzystaniem narzędzi MS TEAMS.

Sposoby weryfikacji i oceny efektów uczenia się:
Uczestnictwo w zajęciach, test, rozwiązanie zadania problemowego.

Kryteria oceny:

1. Na ocenę 5,0 student wyjaśnia rolę rynku finansowego w strukturze społeczno-gospodarczej kraju
2. Na ocenę 5,0 student wyjaśnia strukturę i zasady funkcjonowania rynku finansowego w skali krajowej i międzynarodowej
3. Na ocenę 5,0 student analizuje i interpretuje procesy zachodzące na rynku finansowym w dynamicznie zmieniającym się otoczeniu
4. Na ocenę 5,0 student potrafi prognozować procesy na krajowym rynku finansowym, z uwzględnieniem jego powiązań z globalnym rynkiem finansowym
5. Na ocenę 5,0 student podejmuje decyzje w sposób przedsiębiorczy, biorąc pod uwagę wrażliwość i zmienność rynku finansowego

Literatura:

obowiązkowa:

1. Rynek finansowy i jego mechanizmy: podstawy teorii i praktyki / W. Dębski. – W.: Wydaw. Naukowe PWN. 2007
2. Globalny rynek finansowy / J. Narewski, K. Zabielski. – Łódź: Wydaw. Naukowe Wyższej Szkoły Kupieckiej. 2007
3. Sopoćko A. Rynkowe instrumenty finansowe, Warszawa, Wydaw. Naukowe PWN, 2005.
4. Finanse i instrumenty finansowe / M. Wypych. – Łódź: „Absolwent”: SWSPiZ. 2001

zalecana/fakultatywna:

5. Finansowe instrumenty pochodne / Red. nauk. J. Grzywacz. – W.: Szkoła Główna Handlowa – Oficyna Wydawnicza. 2009
6. Kontrakty terminowe i opcje: wprowadzenie / J. Hull. – W.: WIG-Press. 1997
7. Rynek finansowy: instytucje, strategie, instrumenty / Pod red. P. Kapusia. – Lublin: Wydaw. Uniwersytetu Marii Curie-Skłodowskiej. 2003