

## KARTA PRZEDMIOTU

1.	<b>NAZWA PRZEDMIOTU:</b> Instrumenty i produkty finansowe
2.	<b>KIERUNEK:</b> finanse i rachunkowość
3.	<b>POZIOM STUDIÓW:</b> II stopnia (stacjonarne i niestacjonarne)
4.	<b>ROK/ SEMESTR STUDIÓW:</b> I/2
5.	<b>LICZBA PUNKTÓW ECTS:</b> 3
6.	<b>TYP PRZEDMIOTU<sup>1</sup>:</b> obowiązkowy
7.	<b>JĘZYK WYKŁADOWY:</b> polski
8.	<b>LICZBA GODZIN I FORMA REALIZACJI PRZEDMIOTU<sup>2</sup>:</b>  15W/30 ZP – studia stacjonarne (SS); 15W/15 ZP – studia niestacjonarne (SN)
9.	<b>WYMAGANIA WSTĘPNE:</b> zaliczenie kursów: Matematyka finansowa, Statystyka opisowa, Elementy ekonometrii, Podstawy finansów, Finanse przedsiębiorstw, Rynki finansowe

10.	<b>ZAŁOŻENIA I CELE PRZEDMIOTU:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>– zapoznanie studentów z podstawową terminologią, teoriami i mechanizmami zarządzania ryzykiem,</li> <li>– rozwijanie wśród studentów umiejętności oceny ryzyka towarzyszącego podejmowaniu decyzji we współczesnych instytucjach finansowych.</li> </ul>
-----	--

11.	<b>PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ</b>	<b>Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się (symbol)</b>
	<b>WIEDZA: zna i rozumie</b>	
P_W01	szerokie spektrum instrumentów i produktów finansowych występujących na rynkach finansowych	K2_W02
P_W02	terminologię i narzędzia oraz techniki używane w obszarze zarządzania instrumentami finansowymi	K2_W04, K2_W08
	<b>UMIEJĘTNOŚCI: potrafi</b>	

<sup>1</sup> Obowiązkowy, fakultatywny.

<sup>2</sup> Wykłady, ćwiczenia, laboratoria, konwersatoria.

P_U01	poszukiwać informacji o instrumentach finansowych i produktach finansowych	K2_U02
P_U02	wykonywać wyceny instrumentów finansowych w obrocie pierwotnym i wtórnym	K2_U06
P_U03	budować i szacować parametry modeli rynku kapitałowego	K2_U01, K2_U04, K2_U08
	<b>KOMPETENCJE SPOŁECZNE: jest gotów do</b>	
P_K01	nieustannego uczenia się i rozwoju kompetencji osobistych oraz interpersonalnych, ma świadomość swojej wiedzy i umiejętności, potrafi wyznaczać kierunki własnego rozwoju i kształcenia, uzupełniać i doskonalić nabytą.	K_K01

12.	<b>METODY OCENY EFEKTÓW UCZENIA SIĘ</b>			
	<b>Symbol przedmiotowego efektu uczenia się</b>	<b>Metody (sposoby) oceny<sup>3</sup></b>	<b>Typ oceny<sup>4</sup></b>	<b>Forma dokumentacji</b>
1.	P_W01, P_W02	Egzamin ustny	podsumowująca	Protokół ocen, Zestawy pytań
2.	P_U01, P_U02 P_U03	Śródsemestralne prace zaliczeniowe	formująca	Kolokwium, w formie pisemnej lub elektronicznej
3.	P_W01, P_W02 P_U01, P_U02 P_U03, P_K01	Ocenianie ciągłe	formująca	Dyskusja podczas zajęć

<b>13. KRYTERIA OCENY OSIĄGNIĘTYCH EFEKTÓW UCZENIA SIĘ</b>					
<b>Forma oceny: punktowa</b>					
<b>EFEKTY UCZENIA SIĘ</b>	<b>NA OCENĘ 3,0</b>	<b>NA OCENĘ 3,5</b>	<b>NA OCENĘ 4,0</b>	<b>NA OCENĘ 4,5</b>	<b>NA OCENĘ 5,0</b>
P_W01	5	6	7	8	9
P_W02	5	6	7	8	9
P_U01	5	6	7	8	9
P_U02	5	6	7	8	9
P_U03	5	6	7	8	9
P_K01	5	6	7	8	9
Oceny efektów P_W01 oraz P_W02 są podstawą zdania egzaminu, przy czym ocena końcowa jest średnią arytmetyczną ocen dwóch efektów, pod warunkiem, że z obu student otrzymał przynajmniej ocenę 3. Jeżeli przynajmniej jeden efekt nie zostanie zaliczony ocena końcowa jest niedostateczna. W trybie poprawkowym					

<sup>3</sup> Ocenianie ciągłe (bieżące przygotowanie do zajęć), śródsemestralne zaliczenie pisemne, śródsemestralne zaliczenie ustne, końcowe zaliczenia pisemne, końcowe zaliczenia ustne, egzamin pisemny, egzamin ustny, praca semestralna, ocena umiejętności ruchowych, praca dyplomowa, projekt, kontrola obecności

<sup>4</sup> Formująca, podsumowująca.

student ma możliwość zaliczenia efektów niezaliczonych w trybie zasadniczym.

Oceny efektów z zajęć praktycznych P\_U01, PU\_02 i PU\_03 są podstawą zaliczenia zajęć praktycznych. Dodatkowe uwagi jak wyżej.

#### 14. WARUNKI UZYSKANIA ZALICZENIA PRZEDMIOTU:

Osiągnięcie założonych efektów uczenia się i pozytywny wynik

1. egzaminu pisemnego egzaminu
2. zaliczenia pisemnych kolokwii

15.	<b>TREŚCI PROGRAMOWE</b>		
	<b>Treść zajęć</b>	<b>Forma zajęć<sup>5</sup> (liczba godz.) SS/SN</b>	<b>Symbol przedmiotowych efektów uczenia się</b>
<b>Wykłady</b>			
1.	Instrumenty finansowe. Podstawowe pojęcia i klasyfikacje	2/2	P_W01
2.	Instrumenty rynku pieniężnego <ul style="list-style-type: none"> <li>• Charakterystyka</li> <li>• Wycena</li> </ul>	2/2	P_W01, P_W02
3.	Instrumenty rynku kapitałowego <ul style="list-style-type: none"> <li>• Instrumenty wierzycielskie i udziałowe</li> <li>• Wycena instrumentów wierzycielskich</li> <li>• Analiza akcji</li> <li>• Teoria portfela</li> <li>• Modele rynku kapitałowego</li> </ul>	6/6	P_W01, P_W02
4.	Instrumenty pochodne Charakterystyka Wycena	2/2	P_W01, P_W02
5.	Rynek walutowy	1/1	P_W01
6.	Produkty finansowe na polskim rynku <ul style="list-style-type: none"> <li>• Produkty pożyczkowe i kredytowe</li> <li>• Bankowe produkty oszczędnościowe</li> <li>• Produkty inwestycyjne. Fundusze inwestycyjne i emerytalne</li> <li>• Produkty strukturyzowane</li> </ul>	2/2	P_W01, P_W02
<b>Zajęcia praktyczne</b>			

1.	Instrumenty rynku pieniężnego – bony pieniężne, certyfikaty depozytowe - wycena	4/2	PU_02
2.	Instrumenty rynku kapitałowego – obligacje, akcje - wycena	6/3	PU_02
3.	Instrumenty pochodne – kontrakty terminowe, kontrakty swap, opcje - wycena	6/3	PU_02
4.	Kolokwium	2/1	
5.	Rynek walutowy – transakcje spot i forward	2/1	PU_02
6.	Indeksy rynkowe – konstrukcja, zależności między indeksami na giełdach światowych	2/1	PU_01, PU_03
7.	Teoria portfela wielu spółek	4/1	PU_01, PU_03
8.	Modele CAPM i APT	2/1	PU_03
9.	Kolokwium	2/2	

16.	<b>METODY I FORMY PROWADZENIA ZAJĘĆ</b>	<b>Tak (X) / nie</b>
	Wykład z prezentacją multimedialną wybranych zagadnień	X
	Wykład konwersatoryjny	X
	Wykład problemowy	
	Wykład informacyjny	
	Dyskusja	X
	Praca z tekstem	
	Metoda analizy przypadków	
	Uczenie problemowe ( <i>Problem-based learning</i> )	
	Gra dydaktyczna/symulacyjna	
	Metoda ćwiczeniowa	X
	Metoda warsztatowa	
	Metoda projektu	
	Prezentacja multimedialna	
	Demonstracje dźwiękowe i/lub video	
	Metody aktywizujące (np.: „burza mózgów”, technika analizy SWOT, technika drzewka decyzyjnego, metoda „kuli śniegowej”,	

	konstruowanie „map myśli”)	
	Praca w grupach	
	Praca indywidualna ze studentem (w tym tutoring)	
	Inne (jakie?) - .....	

17.	<p><b>LITERATURA PODSTAWOWA I UZUPEŁNIAJĄCA<sup>6</sup>:</b></p> <p><b>Literatura podstawowa:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Dębski W., <i>Rynek finansowy i jego mechanizmy</i>. Wyd. 6, PWN, Warszawa, 2014..</li> <li>2. A. Sopoćko, <i>Rynkowe instrumenty finansowe</i>. Wyd. 2, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2010.</li> <li>3. Jajuga K., Jajuga T., <i>Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa</i>. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2015.</li> <li>4. Szczerbak M., Waśkiewicz R., Wikarczyk A., <i>Instrumenty finansowe. Wycena, ewidencja, sprawozdawczość</i>, Difin 2021</li> </ol> <p><b>Literatura uzupełniająca:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. J. Czekał (red.), <i>Rynki, Instrumenty i instytucje finansowe</i>. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2017.</li> </ol>
-----	--

18.	<b>OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA</b>			
	Forma aktywności	Rodzaj zajęć	Liczba godzin na zrealizowanie aktywności w semestrze	
			Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
	Wykłady	Zajęcia wymagające udziału Prowadzącego	15	15
	zajęcie praktyczne		30	15
	Ćwiczenia			
	Laboratoria			
	.....			
	.....			

	<i>Łączna liczba godzin zajęć realizowanych z udziałem prowadzącego</i>		<b>45</b>	<b>30</b>
	przygotowanie się do zajęć	Praca własna studenta	10	15
	przygotowanie się do zaliczeń/kolokwiów		10	15
	przygotowanie się do egzaminu/zaliczenia końcowego		10	15
	.....			
	<i>Łączna liczba godzin pracy własnej studenta</i>		30	45
	<b><i>Razem godzin</i></b> <i>(zajęcia z udziałem prowadzącego + praca własna studenta)</i>		<b>75</b>	<b>75</b>
	Liczba punktów ECTS		3	3

<b>19.</b>	<b>PROWADZĄCY PRZEDMIOT (IMIE, NAZWISKO, ADRES E-MAIL, INSTYTUT, NR POKOJU KONSULTACJI)</b> mgr Jarosław Bielak <a href="mailto:jaroslaw.bielak@akademiazamojska.edu.pl">jaroslaw.bielak@akademiazamojska.edu.pl</a> Instytut Społeczno-Ekonomiczny, (ul. Zamoyskiego 64) p. 205
------------	---