



Karta przedmiotu
Portfel inwestycyjny

1. Informacje podstawowe

Kierunek studiów finanse i rachunkowość Specjalność - Jednostka zarządzająca kierunkiem studiów Wydział Zarządzania Poziom studiów drugiego stopnia (mgr) Profil studiów Profil praktyczny Forma studiów studia stacjonarne	Cykl kształcenia (nabór) 2024/25 Kod przedmiotu 08FIR-PS.DM2C.3290.24 Języki wykładowe polski Obligatoryjność Fakultatywny Blok zajęciowy Przedmioty kierunkowe	
Wymagania wstępne	brak	
Przedmioty wprowadzające	brak	
Koordynator	Zbigniew Drewniak	
Okres Semestr 2	Forma i godziny zajęć <ul style="list-style-type: none">Wykład: 15, EgzaminĆwiczenia audytoryjne: 15, Zaliczenie na ocenęĆwiczenia laboratoryjne: 15, Zaliczenie na ocenę	Liczba punktów ECTS 3

2. Efekty uczenia się dla przedmiotu

Kod	Opis efektów uczenia się	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się	Odniesienie do charakterystyk PRK
-----	--------------------------	---	-----------------------------------

Kod	Opis efektów uczenia się	Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się	Odniesienie do charakterystyk PRK
Wiedza:			
W1	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu metody pomiaru dochodu i ryzyka instrumentu finansowego.	FIR_P2_K_W02	P7S_WG
W2	Zna i rozumie zasady budowy portfeli dwu- i wieloskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu.	FIR_P2_K_W05	P7S_WG
Umiejętności:			
U1	Potrafi wyznaczyć dochód oraz oszacować ryzyko inwestycji w dany instrument finansowy.	FIR_P2_K_U01	P7S_UW
U2	Potrafi skonstruować portfel dwu- i wieloskładnikowy.	FIR_P2_K_U07	P7S_UW
Kompetencje społeczne:			
K1	Jest gotów wykorzystać wiedzę na temat podstaw budowy i zarządzania portfelem inwestycyjnym w podejmowaniu decyzji inwestycyjnych w sposób efektywny i etyczny.	FIR_P2_K_K04	P7S_KR

3. Treści programowe

Lp.	Treści programowe	Formy zajęć	Efekty uczenia się dla przedmiotu
1.	Wykład Rynek finansowy i instrumenty rynku finansowego. Dochód instrumentu finansowego. Stopa zwrotu i średnia stopa zwrotu. Korelacja stóp zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu pomiaru dochodu instrumentu finansowego. Ćwiczenia laboratoryjne Źródła danych o notowaniach instrumentów finansowych, dobór spółek do portfela i wyznaczenie stopy zwrotu i średniej stopy zwrotu.	Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne	W1, U1, K1
2.	Wykład Ryzyko instrumentu finansowego - pojęcie, rodzaje i metody pomiaru. Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu mier ryzyka. Ćwiczenia laboratoryjne Wyznaczenie ryzyka analizowanych instrumentów finansowych.	Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne	W1, U1, K1
3.	Wykład Portfel dwuskładnikowy o minimalnym ryzyku, portfel dwuskładnikowy o zakładanej stopie zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Obliczanie ryzyka portfela dwuskładnikowego. Ćwiczenia laboratoryjne Budowa portfeli dwuskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu.	Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne	W2, U2, K1

Lp.	Treści programowe	Formy zajęć	Efekty uczenia się dla przedmiotu
4.	Wykład Portfel wieloskładnikowy o minimalnym ryzyku, portfel wieloskładnikowy o zakładanej stopie zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Obliczanie ryzyka portfela wieloskładnikowego. Ćwiczenia laboratoryjne Budowa portfeli wieloskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu.	Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne	W2, U2, K1
5.	Wykład Portfel z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu portfeli z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka.	Wykład, Ćwiczenia audytoryjne	W1, W2, U1, U2, K1

4. Metody prowadzenia zajęć, weryfikacji efektów uczenia się i warunki zaliczenia

Forma zajęć		
Wykład	Metody prowadzenia zajęć:	
	Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne, Ćwiczenia rachunkowe	
	Metody (sposoby) weryfikacji:	Udział:
	Egzamin pisemny	100%
	Warunki zaliczenia przedmiotu:	
Test składający się z pytania otwartego, pytań typu prawda/fałsz oraz pytań testowych. Możliwość uzyskania dodatkowych punktów za aktywność na zajęciach.		
Ćwiczenia audytoryjne	Metody prowadzenia zajęć:	
	Ćwiczenia rachunkowe	
	Metody (sposoby) weryfikacji:	Udział:
	Kolokwium	100%
	Warunki zaliczenia przedmiotu:	
Kolokwium składające się z zadań do rozwiązania.		
Ćwiczenia laboratoryjne	Metody prowadzenia zajęć:	
	Projekt	
	Metody (sposoby) weryfikacji:	Udział:
	Projekt	100%
	Warunki zaliczenia przedmiotu:	
Przygotowanie projektu polegającego na zbudowaniu portfela dwu- lub trzyskładnikowego.		

Efekt uczenia się dla przedmiotu	Metody (sposoby) weryfikacji		
	Egzamin pisemny	Kolokwium	Projekt

W1	x	x	
W2	x	x	
U1		x	x
U2		x	x
K1	x	x	x

5. Literatura

Literatura podstawowa

1. Czapiewski P. , Niedziółka P., 2016. Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, Diffin.
2. Jajuga K., Jajuga T., 2015. Inwestycje. Instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, Inżynieria finansowa, PWN.
3. Ostrowska E., 2014. Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H. Beck.
4. Capiński M.J., Kopp E., 2014. Portfolio Theory and Risk Management, Cambridge University Press.

Literatura uzupełniająca

1. Borowski K., 2014. Miary ryzyka na rynku akcji i obligacji, Diffin.
2. Reilly F., Brown K., 2001. Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, PWE.

6. Nakład pracy studenta - bilans godzin i punktów ECTS

Aktywność studenta		Obciążenie studenta Liczba godzin
Zajęcia prowadzone z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego lub innych osób prowadzących zajęcia	Wykład	15
	Ćwiczenia audytoryjne	15
	Ćwiczenia laboratoryjne	15
Praca własna studenta	Konsultacje	7
	Przygotowanie do zajęć	5
	Przygotowanie projektu	15
	Przygotowanie do egzaminu	10
	Studiowanie literatury	8
Łączny nakład pracy studenta		90
Liczba punktów ECTS		3

* Godzina (dydaktyczna) oznacza 45 minut