

PAŃSTWOWA WYŻSZA SZKOŁA ZAWODOWA W NOWYM SĄCZU

KARTA PRZEDMIOTU

obowiązuje studentów rozpoczynających studia w roku akademickim 2013/2014

Instytut Ekonomiczny

Kierunek studiów: Ekonomia

Profil: Ogólnoakademicki

Forma studiów: Stacjonarne

Kod kierunku: E

Stopień studiów: I

Specjalności: Finanse i rachunkowość przedsiębiorstw

1 PRZEDMIOT

| | |
|----------------------|-------------------------------------|
| NAZWA PRZEDMIOTU | Zarządzanie portfelem inwestycyjnym |
| KOD PRZEDMIOTU | IE E AIS C18 13/14 |
| KATEGORIA PRZEDMIOTU | Przedmioty specjalnościowe |
| LICZBA PUNKTÓW ECTS | 3 |
| SEMESTRY | 6 |

2 RODZAJ ZAJĘĆ, LICZBA GODZIN W PLANIE STUDIÓW

| SEMESTR | WYKŁAD | CWICZENIA | LABORATORIUM | PROJEKT | SEMINARIUM |
|---------|--------|-----------|--------------|---------|------------|
| 6 | 15 | 15 | | | |

3 CELE PRZEDMIOTU

Cel 1 Zapoznanie studentów z podstawowymi pojęciami z zakresu rynku finansowego oraz inwestycji finansowych.

Cel 2 Przekazanie studentom wiedzy na temat metod analizy inwestycji oraz pomiaru ryzyka inwestycyjnego.

Cel 3 Wykształcenie umiejętności konstruowania efektywnych portfeli inwestycyjnych przy wykorzystaniu poznanych metod.

Cel 4 Wykształcenie kompetencji polegającej na zdolności do pracy w grupie oraz etycznej postawy zawodowej.



4 WYMAGANIA WSTĘPNE W ZAKRESIE WIEDZY, UMIEJĘTNOŚCI I INNYCH KOMPETENCJI

- a Podstawowa wiedza zdobyta w ramach przedmiotu podstawy finansów.
- b Doświadczenie życiowe polegające na korzystaniu z usług finansowych.

5 EFEKTY KSZTAŁCENIA

- EK1** Wiedza: Student definiuje podstawowe pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych.
- EK2** Wiedza: Student zna metody oraz techniki analizy inwestycji oraz sposoby pomiaru ryzyka inwestycyjnego.
- EK3** Umiejętności: Student dobiera i wykorzystuje poznane metody i narzędzia do konstruowania efektywnych portfeli inwestycyjnych.
- EK4** Kompetencje społeczne: Student potrafi współpracować w grupie oraz prezentuje etyczną postawę zawodową

6 TREŚCI PROGRAMOWE

WYKŁAD

| LP | TEMATYKA ZAJĘĆ OPIS SZCZEGÓŁOWY BLOKÓW TEMATYCZNYCH | LICZBA GODZIN |
|----|--|---------------|
| W1 | Istota i funkcjonowanie rynku finansowego - podstawowe pojęcia, struktura rynku finansowego. | 2 |
| W2 | Stopa zwrotu i ryzyko w inwestycjach finansowych. | 2 |
| W3 | Portfel papierów wartościowych - podstawowe pojęcia, zasady budowy, cel zakres. | 3 |
| W4 | Dywersyfikacja ryzyka - podejście klasyczne i nieklasyczne. | 2 |
| W5 | Teoria portfelowa - model Markowitza i model Sharpe'a. | 4 |
| W6 | Teoria użyteczności w inwestycjach finansowych. | 1 |
| W7 | Strategie inwestycyjne. | 1 |
| | RAZEM | 15 |

CWICZENIA

| LP | TEMATYKA ZAJĘĆ OPIS SZCZEGÓŁOWY BLOKÓW TEMATYCZNYCH | LICZBA GODZIN |
|----|--|---------------|
| C1 | Stopa zwrotu i ryzyko w inwestycjach finansowych. | 3 |
| C2 | Portfel papierów wartościowych - stopa zwrotu i ryzyko portfela. | 4 |
| C3 | Teoria portfelowa - model Markowitza i model Sharpe'a. | 4 |
| C4 | Teoria użyteczności w inwestycjach finansowych. | 2 |
| C5 | Strategie inwestycyjne. | 2 |
| | RAZEM | 15 |

7 METODY DYDAKTYCZNE

- M1** Wykłady
- M2** Praca w grupach
- M3** Zadania tablicowe



8 OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA

| FORMA AKTYWNOŚCI | ŚREDNIA LICZBA GODZIN NA ZREALIZOWANIE AKTYWNOŚCI |
|--|--|
| Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim, w tym: | |
| Godziny wynikające z planu studiów | 30 |
| Konsultacje przedmiotowe | 6 |
| Egzaminy i zaliczenia w sesji | 2 |
| Godziny bez udziału nauczyciela akademickiego wynikające z nakładu pracy studenta, w tym: | |
| Przygotowanie się do zajęć, w tym studiowanie zalecanej literatury | 30 |
| Opracowanie wyników | 7 |
| Przygotowanie raportu, projektu, prezentacji, dyskusji | 0 |
| SUMARYCZNA LICZBA GODZIN DLA PRZEDMIOTU WYNIKAJĄCA Z CAŁEGO NAKŁADU PRACY STUDENTA | 75 |
| SUMARYCZNA LICZBA PUNKTÓW ECTS DLA PRZEDMIOTU | 3 |

9 SPOSOBY OCENY

OCENA FORMUJĄCA

F1 Kolokwium

F2 Aktywność na zajęciach

F3 Zadanie tablicowe

KRYTERIA OCENY

| EFEKT KSZTAŁCENIA 1 | | MIEJSCE WERYFIKACJI | OPIS WERYFIKACJI EK 1 |
|---------------------|--|------------------------|-------------------------|
| NA OCENĘ 3 | Student zna podstawowe pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych. | wykład | Ocena z egzaminu (100%) |
| NA OCENĘ 4 | Student definiuje pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych, a także wskazuje na najważniejsze cechy definiowanego pojęcia. | | |
| NA OCENĘ 5 | Student doskonale orientuje się w zagadnieniach z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych, jak też rozumie zależności pomiędzy definiowanymi pojęciami. | | |
| EFEKT KSZTAŁCENIA 2 | | MIEJSCE WERYFIKACJI | OPIS WERYFIKACJI EK 2 |
| NA OCENĘ 3 | Student wymienia podstawowe metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych oraz metody pomiaru ryzyka inwestycyjnego. | wykład | Ocena z egzaminu (100%) |
| NA OCENĘ 4 | Student wymienia podstawowe metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych oraz metody pomiaru ryzyka inwestycyjnego oraz potrafi porównać wybrane metody. | | |



| | | | |
|---------------------|--|------------------------|---|
| NA OCENĘ 5 | Student wymienia metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych oraz metody pomiaru ryzyka inwestycyjnego, jak też dokonuje oceny przydatności tych metod w określonych warunkach. | | |
| EFEKT KSZTAŁCENIA 3 | | MIEJSCE WERYFIKACJI | OPIS WERYFIKACJI EK 3 |
| NA OCENĘ 3 | Student dobiera i wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych do rozwiązywania prostych zadań. | ćwiczenia | Ocena z kolokwium (50%) i średnia arytmetyczna ocen z aktywności na zajęciach (50%) |
| NA OCENĘ 4 | Student dobiera i wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych do rozwiązywania złożonych zadań. | | |
| NA OCENĘ 5 | Student dobiera i wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych oraz potrafi łączyć różne metody w celu rozwiązania skomplikowanych zadań. | | |
| EFEKT KSZTAŁCENIA 4 | | MIEJSCE WERYFIKACJI | OPIS WERYFIKACJI EK 4 |
| NA OCENĘ 3 | Student aktywnie współpracuje z grupą i przejawia etyczną postawę. | ćwiczenia | Ocena z aktywności na zajęcia i pracy w grupach (100%) |
| NA OCENĘ 4 | Student wyróżnia się aktywnością w grupie oraz wykazuje etyczną postawę w rozwiązywaniu postawionych problemów. | | |
| NA OCENĘ 5 | Student jest liderem w grupie oraz inicjuje rozwiązania postawionych problemów, z zachowaniem zasad etyki zawodowej. | | |

OCENA DO INDEKSU (OCENA PODSUMOWUJĄCA)

Średnia arytmetyczna ocen ze wszystkich efektów kształcenia.

10 MACIERZ REALIZACJI PRZEDMIOTU

| EFEKTY KSZTAŁCENIA DLA PRZEDMIOTU | ODNIESIENIE DO EFEKTÓW KIERUNKOWYCH | CELE PRZEDMIOTU | TREŚCI PROGRAMOWE | METODY DYDAKTYCZNE |
|--|---|-----------------|---------------------------|-----------------------|
| EK1 | E_W14 | Cel1, Cel2 | W1, W2 | M1 |
| EK2 | E_W14 | Cel2 | W3, W4, C1, C2 | M1, M2, M3 |
| EK3 | E_U07 | Cel3 | W4, W5, W6, C3, C4, C5 | M1, M2, M3 |
| EK4 | E_K08 | Cel4 | W1, W7 | M1 |



11 WYKAZ LITERATURY

LITERATURA PODSTAWOWA:

- [1] Elton E.J., Gruber M.J. — *Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych*, Warszawa, 1998, WIG Press
- [2] Jajuga K., Jajuga T. — *Inwestycje*, Warszawa, 2011, PWN

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

- [1] Łuniewska M., Tarczyoski W. — *Metody wielowymiarowej analizy porównawczej na rynku kapitałowym*, Warszawa, 2006, PWN

12 INFORMACJE O NAUCZYCIELACH AKADEMICKICH

OSOBA ODPOWIEDZIALNA ZA KARTĘ

mgr Mariusz Bołoz (kontakt: mariuszboloz@gmail.com)

OSOBY PROWADZĄCE PRZEDMIOT

mgr Mariusz Bołoz (kontakt: mariuszboloz@gmail.com)

13 ZATWIERDZENIE KARTY PRZEDMIOTU DO REALIZACJI

| | | | |
|---------------------|-------------------------------|---------------------|----------------------|
| (miejscowość, data) | (odpowiedzialny za przedmiot) | (kierownik zakładu) | (dyrektor instytutu) |
|---------------------|-------------------------------|---------------------|----------------------|

PRZYJMUJĘ DO REALIZACJI (data i podpisy osób prowadzących przedmiot)

.....