

# PAŃSTWOWA WYŻSZA SZKOŁA ZAWODOWA W NOWYM SĄCZU

## KARTA PRZEDMIOTU

obowiązuje studentów rozpoczynających studia w roku akademickim 2014/2015

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 14/15
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
<b>Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim, w tym:</b>	
Godziny wynikające z planu studiów	30
Konsultacje przedmiotowe	6
Egzaminy i zaliczenia w sesji	2
<b>Godziny bez udziału nauczyciela akademickiego wynikające z nakładu pracy studenta, w tym:</b>	
Przygotowanie się do zajęć, w tym studiowanie zalecanej literatury	30
Opracowanie wyników	7
Przygotowanie raportu, projektu, prezentacji, dyskusji	0
<b>SUMARYCZNA LICZBA GODZIN DLA PRZEDMIOTU WYNIKAJĄCA Z CAŁEGO NAKŁADU PRACY STUDENTA</b>	<b>75</b>
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)

.....