

PAŃSTWOWA WYŻSZA SZKOŁA ZAWODOWA W NOWYM SĄCZU

KARTA PRZEDMIOTU

obowiązuje studentów rozpoczynających studia w roku akademickim 2015/2016

Instytut Ekonomiczny

Kierunek studiów: Ekonomia

Profil: Ogólnoakademicki

Forma studiów: Niestacjonarne

Kod kierunku: E

Stopień studiów: I

Specjalności: Finanse i rachunkowość przedsiębiorstw

1 PRZEDMIOT

NAZWA PRZEDMIOTU	Zarządzanie portfelem inwestycyjnym
KOD PRZEDMIOTU	IE E AIN C17 15/16
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	9	9			

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.	1
W2	Stopa zwrotu i ryzyko w inwestycjach finansowych.	1
W3	Portfel papierów wartościowych - podstawowe pojęcia, zasady budowy, cel zakres.	2
W4	Dywersyfikacja ryzyka - podejście klasyczne i nieklasyczne.	1
W5	Teoria portfelowa - model Markowitza i model Sharpe'a.	3
W6	Teoria użyteczności w inwestycjach finansowych.	1
	RAZEM	9

CWICZENIA

LP	TEMATYKA ZAJĘĆ OPIS SZCZEGÓŁOWY BLOKÓW TEMATYCZNYCH	LICZBA GODZIN
C1	Stopa zwrotu i ryzyko w inwestycjach finansowych.	2
C2	Portfel papierów wartościowych - stopa zwrotu i ryzyko portfela.	2
C3	Teoria portfelowa - model Markowitza i model Sharpe'a.	3
C4	Teoria użyteczności w inwestycjach finansowych.	1
C5	Strategie inwestycyjne.	1
	RAZEM	9

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	18
Konsultacje przedmiotowe	3
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	40
Opracowanie wyników	12
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, W6	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

dr Jolanta Juza (kontakt: juzaj@onet.pl)

OSOBY PROWADZĄCE PRZEDMIOT

dr Jolanta Juza (kontakt: juzaj@onet.pl)

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)

.....

.....