

PAŃSTWOWA WYŻSZA SZKOŁA ZAWODOWA W NOWYM SĄCZU

KARTA PRZEDMIOTU

obowiązuje studentów rozpoczynających studia w roku akademickim 2012/2013

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 12/13
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 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

OCENA PODSUMOWUJĄCA

P1 Egzamin pisemny

KRYTERIA OCENY

EFEKT KSZTAŁCENIA 1	
NA OCENĘ 3	Student zna podstawowe pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 4	Student bardzo dobrze zna i rozumie pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 5	Student doskonale zna pojęcia z zakresu funkcjonowania rynku finansowego oraz inwestycji finansowych, jak też rozumie zależności pomiędzy tymi pojęciami.
EFEKT KSZTAŁCENIA 2	
NA OCENĘ 3	Student z niewielką pomocą wymienia podstawowe metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 4	Student bardzo dobrze zna metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 5	Student doskonale zna metody oraz narzędzia analizy inwestycji finansowych, jak też dokonuje oceny przydatności tych metod.
EFEKT KSZTAŁCENIA 3	
NA OCENĘ 3	Student dobiera i z pomocą nauczyciela akademickiego wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 4	Student samodzielnie dobiera i wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych.
NA OCENĘ 5	Student samodzielnie dobiera i wykorzystuje metody i narzędzia analizy inwestycji finansowych oraz potrafi łączyć różne metody w celu osiągnięcia pożądanego wyniku.
EFEKT KSZTAŁCENIA 4	



NA OCENĘ 3	Student aktywnie współpracuje z grupą i przejawia etyczną postawę.
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.

10 MACIERZ REALIZACJI PRZEDMIOTU

EFEKTY KSZTAŁCENIA DLA PRZEDMIOTU	ODNIESIENIE DO EFEKTÓW KIERUNKOWYCH	CELE PRZEDMIOTU	TREŚCI PROGRAMOWE	METODY DYDAKTYCZNE	SPOSOBY OCENY
EK1	E_W14	Cel1, Cel2	W1, W2	M1	P1
EK2	E_W14, E_U07	Cel2	W3, W4, C1, C2	M1, M2, M3	F1, F2, F3, P1
EK3	E_U07	Cel3	W4, W5, W6, C3, C4, C5	M1, M2, M3	F1, F2, F3, P1
EK4	E_K08	Cel4	W1, W7	M1	P1

11 WYKAZ LITERATURY

LITERATURA PODSTAWOWA:

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

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA:

- [1] Łuniewska M., Tarczyński 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)

.....

PWSZ w Nowym Sączu