

KARTA MODUŁU

I. OGÓLNE INFORMACJE O MODULE

COLLEGIUM WITELONA UCZELNIA PAŃSTWOWA WYDZIAŁ NAUK TECHNICZNYCH I EKONOMICZNYCH

Kierunek studiów:	FINANSE I ZARZĄDZANIE W PRZEDSIĘBIORSTWIE					
Poziom studiów:	studia drugiego stopnia					
Profil studiów:	praktyczny					
Forma studiów:	stacjonarne/niestacjonarne					
Nazwa modułu:	Portfel inwestycyjny					
Rodzaj modułu:	Obowiązkowy					
Język wykładowy:	Język polski*					
Rok studiów:	1	Formy prowadzenia zajęć wraz z liczbą godzin dydaktycznych:				
Semestr:	2	Wykład	Ćwiczenia	Warsztat	Projekt	Seminarium
Liczba punktów ECTS ogółem:	2	15/10	-	30/14	-	-
Forma zaliczenia:	Zaliczenie na ocenę					
Wymagania wstępne:	Wiedza z zakresu rynków finansowych, podstawy matematyki finansowej					

II. CELE KSZTAŁCENIA

Cele kształcenia:

Cel1: zapoznanie z rodzajami instrumentów finansowych i metodami ich wyceny, a także metodami zarządzania portfelem inwestycyjnym
 Cel2: rozumienie konieczności zarządzania portfelem inwestycyjnym

III. EFEKTY UCZENIA SIĘ WRAZ Z ODNIESIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKOWYCH ORAZ METODY WERYFIKACJI EFEKTÓW

Efekt	Student, który zaliczył moduł w zakresie:	Odniesienie do efektów kierunkowych	Metody weryfikacji
wiedzy:			
W01	Ma wiedzę na temat metod konstrukcji i oceny portfeli inwestycyjnych	K2FZ_W03	Kolokwium zaliczeniowe
umiejętności:			
U01	Potrafi konstruować portfele inwestycyjne, ograniczać i dywersyfikować ryzyko inwestycyjne Zna w sposób pogłębiony metody i narzędzia opisu właściwe dla nauk ekonomicznych, ma pogłębioną wiedzę o wykorzystaniu metod ilościowych w finansach i zarządzaniu podmiotem gospodarczym.	K2FZ_U04 K2FZ_U05 K2FZ_U08 K2FZ_U10	Kolokwium zaliczeniowe
kompetencji społecznych:			
-	-	-	-

IV. TREŚCI PROGRAMOWE

Treści programowe (tematyka zajęć, zaprezentowana z podziałem na poszczególne formy zajęć z określeniem liczby godzin potrzebnych na ich realizację)

Wykłady

Kod	Tematyka zajęć	Liczba godzin S/N
w1	Wprowadzenie, rodzaje instrumentów finansowych	2/2
w2	Dochód a ryzyko, dywersyfikacja portfela inwestycyjnego	2/2
w3	Podstawy wyceny papierów wartościowych	2/1

w4	Zarządzanie portfelem akcji	4/2
w5	Zarządzanie portfelem obligacji	2/1
w6	Ocena efektywności portfela inwestycyjnego Zaliczenie wykładu	3/2

Warsztaty

Kod	Tematyka zajęć	Liczba godzin S/N
wt1	Rodzaje oraz funkcje instrumentów finansowych	2/1
wt2	Analiza dochód a ryzyko inwestycji, sposoby ograniczania ryzyka inwestycji, dywersyfikacja ryzyka	4/2
wt3	Podstawy wyceny papierów wartościowych	2/1
wt4	Analiza fundamentalna i techniczna akcji, model Markowitza, model CAPM, model Sharpe'a	8/3
wt5	Zarządzanie portfelem obligacji	4/2
wt6	Zarządzanie instrumentami pochodnymi	4/2
wt7	Wskaźniki rentowności portfela inwestycji	3/1
wt8	Portfel inwestycyjny funduszy emerytalnych, banków, zakładów ubezpieczeń	3/2

V. METODY KSZTAŁCENIA, NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE

- 1. Metody kształcenia:**
wykład multimedialny
zajęcia warsztatowe z obliczeniami przy tablicy
- 2. Narzędzia (środki) dydaktyczne:**
tablica multimedialna

VI. FORMA I KRYTERIA ZALICZENIA MODUŁU

Forma zaliczenia modułu

Zaliczenie na ocenę

Kryteria oceny formującej***:

obserwacja realizacji zadań podczas zajęć
obserwacja aktywności podczas zajęć

Kryteria oceny podsumowującej***

Kolokwia pisemne

50-59% - ocena dostateczna
60-69% - ocena dostateczna plus
70-79% - ocena dobra
80-89% - ocena dobra plus
powyżej 90% - ocena bardzo dobra

Ocena podsumowująca***:

Ocena z modułu: średnia ocen z poszczególnych form zajęć

VII. BILANS PUNKTÓW ECTS - NAKŁAD PRACY STUDENTA

Kategoria	Obciążenie studenta (S/N)
Liczba godzin realizowanych przy bezpośrednim udziale nauczyciela (godziny kontaktowe)	45/24
Udział w wykładach	15/10
Udział w innych formach zajęć (**) warsztat	30/14
Inne: udział w egzaminie	-
Samodzielna praca studenta (godziny niekontaktowe)	5/26
Przygotowanie do wykładu	2/12

Przygotowanie do innych form zajęć (**) warsztat	2/13
Przygotowanie do egzaminu	-
Przygotowanie do zaliczenia innych zajęć (**) warsztat	1
Inne (np. gromadzenie materiałów do projektu, kwerenda internetowa, opracowanie prezentacji multimedialnej itp.)	-
Łączna liczba godzin	50
Punkty ECTS za moduł	2

VIII. ZALECANA LITERATURA

Literatura podstawowa:

1. K. Jajuga, T. Jajuga, Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Wydawnictwo Naukowe PWN, wyd. 3, Warszawa 2015
2. E. Ostrowska, Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny - metody oceny, Wydawnictwo C. H. Beck, Warszawa 2014

Literatura uzupełniająca:

1. W. Dębski, Rynek finansowy i jego mechanizmy, Wydawnictwo Naukowe PWN, wyd. 5, Warszawa 2012
2. E. Elton, M. J. Gruber, Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, WIG-Press, Warszawa 1998
3. F. K. Reilly, K. C. Brown, Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2001

*należy odpowiednio wypełnić

**należy wpisać formę/formy przypisane do modułu określone w programie studiów (wykład, ćwiczenia, seminarium, konwersatorium, lektorat, laboratorium, warsztat, projekt, zajęcia praktyczne, zajęcia terenowe, zajęcia wychowania fizycznego, praktyka zawodowa, inne)

*** proszę wpisać odpowiednie kryteria oceny formującej i podsumowującej