

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:	MODUŁ KSZTAŁCENIA KIERUNKOWEGO					
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:	Zoc					
Wymagania wstępne:	Wiedza z zakresu rynków finansowych, podstawy matematyki finansowej					

II. CELE KSZTAŁCENIA

Cele kształcenia:

- Cel 1: zapoznanie z rodzajami instrumentów finansowych i metodami ich wyceny, a także metodami zarządzania portfelem inwestycyjnym
 Cel 2: rozumienie konieczności zarządzania portfelem inwestycyjnym

III. EFEKTY UCZENIA SIĘ WRAZ Z ODNIESIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKOWYCH

Efekt uczenia się	Student, który zaliczył moduł w zakresie:	Odniesienie do efektów kierunkowych
wiedzy:		
W01	ma wiedzę na temat metod konstrukcji i oceny portfeli inwestycyjnych	K2FZ_W03 K2FZ_W04 K2FZ_W07 K2FZ_W08
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
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	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, dyskusja, prezentacje studentów		
2. Narzędzia (środki) dydaktyczne: tablica multimedialna		
VI. FORMA I KRYTERIA ZALICZENIA MODUŁU		
1. Formy zaliczenia : • Zaliczenie z oceną • Prezentacja - warsztat		
2. Sposób weryfikacji i oceniania efektów uczenia się: • obserwacja realizacji zadań podczas zajęć, obserwacja aktywności podczas zajęć		
3. Podstawowe kryteria oceny lub wymagania egzaminacyjne określone są indywidualnie, jednak powinny zachować adekwatność wobec zaplanowanych efektów uczenia się		
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	
Samodzielna praca studenta (godziny niekontaktowe)	5/26	
Przygotowanie do wykładu	2/10	
Przygotowanie do innych form zajęć (**) warsztat	2/10	
Przygotowanie do egzaminu	-	
Przygotowanie do zaliczenia innych zajęć (**): wykład, warsztat	1/6	
Łączna liczba godzin	50	
Punkty ECTS za modul	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

Na kierunkach studiów, na których obowiązują standardy kształcenia oraz odrębne przepisy określone przez właściwego ministra, karty modułów powinny także uwzględniać powyższe uregulowania

*należy odpowiednio wypełnić

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