

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**	Warsztat**		
Liczba punktów ECTS ogółem:	2	15/10	30/14		
Forma zaliczenia:	Zaliczenie z oceną				
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
W02	zna podstawy wyceny papierów wartościowych	K2FZ_W04
W03	wie na czym polega dywersyfikacja portfela inwestycyjnego	K2FZ_W07
W04	zna zasady oceny efektywności portfela inwestycyjnego	K2FZ_W08
umiejętności:		
U01	potrafi konstruować portfele inwestycyjne	K2FZ_U04
U02	potrafi ograniczać i dywersyfikować ryzyko inwestycyjne	K2FZ_U05
U03	umie ocenić efektywność portfela inwestycyjnego	K2FZ_U08
U04	potrafi obliczyć wskaźniki rentowności portfela inwestycji	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	Przedstawienie treści karty modułu. 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	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: prezentacje multimedialne, wykład informacyjny

Warsztat: dyskusja, prezentacje studentów, metoda problemowa

2. Narzędzia (środki) dydaktyczne: tablica multimedialna, dokumenty źródłowe

VI. FORMA I KRYTERIA ZALICZENIA MODUŁU

1. Formy zaliczenia :

Wykład: zaliczenie z oceną

Warsztat: zaliczenie z oceną

2. Sposób weryfikacji i oceniania efektów uczenia się:

Wykład:

- praca zaliczeniowa – kryteria oceny: • 51% - 60% - ocena dostateczna, • 61% - 70% - ocena dostateczna plus, • 71% - 80% - ocena dobra, • 81% - 90% - ocena dobra plus, • 91% - 100% - ocena bardzo dobra.

Warsztat:

- przygotowanie referatu, projektu.

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 warsztatach	30/14
Samodzielna praca studenta (godziny niekontaktowe)	5/26
Przygotowanie do wykładu	2/7
Przygotowanie do warsztatu	1/7
Przygotowanie do zaliczenia wykładu	1/6
Przygotowanie do zaliczenia warsztatu	1/6
Łączna liczba godzin	50
Punkty ECTS za moduł	2

VIII. ZALECANA LITERATURA

Literatura podstawowa:

1. Jajuga, K., Jajuga, T. (2015). Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. PWN.
2. Ostrowska, E. (2014). Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny - metody oceny, CH Beck.

Literatura uzupełniająca:

1. Dębski, W. (2012). Rynek finansowy i jego mechanizmy, PWN.
2. Elton, E., Gruber, M.J. (1998). Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, WIG-Press.
3. Reilly, F.K., Brown, K.C. (2001). Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem. PWE.

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)