

Karta Modułu Kształcenia

Państwowa Wyższa Szkoła Zawodowa im. Witelona w Legnicy Wydział Nauk Technicznych i Ekonomicznych					
Kierunek studiów:			Finanse i Zarządzanie w Przedsiębiorstwie		
Poziom kształcenia:			Studia drugiego stopnia		
Profil kształcenia:			Praktyczny		
Forma studiów:			Stacjonarne, niestacjonarne		
Nazwa modułu kształcenia:			Portfel inwestycyjny		
Rodzaj modułu kształcenia:			Obowiązkowy		
Sposób realizacji modułu:			Zajęcia kontaktowe		
Rok studiów	Semestr	ECTS	Formy zajęć i liczba godzin w planie studiów	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
1	2	2	Wykład	15	10
			Warsztat	30	14

Cele kształcenia:

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

Wymagania wstępne w zakresie wiedzy, umiejętności i kompetencji społecznych:

wiedza z zakresu rynków finansowych, podstawy matematyki finansowej

Efekty kształcenia w zakresie wiedzy, umiejętności i kompetencji społecznych:

Kod efektu	Zakres efektu	Opis efektu
EK1	wiedza	Ma wiedzę na temat metod konstrukcji i oceny portfeli inwestycyjnych
EK2	umiejętności	Potrafi konstruować portfele inwestycyjne, ograniczać i dywersyfikować ryzyko inwestycyjne

Treści programowe

Forma zajęć: wykład		Liczba godzin	
Kod	Tematyka zajęć	studia stacjonarne	studia niestacjonarne
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	3	2
w6	Ocena efektywności portfela inwestycyjnego	2	1

Forma zajęć: warsztat		Liczba godzin	
Kod	Tematyka zajęć	studia stacjonarne	studia niestacjonarne
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	4	2
wt8	Portfel inwestycyjny funduszy emerytalnych, banków, zakładów ubezpieczeń	2	1

Metody kształcenia (narzędzia dydaktyczne):

MK1: wykład multimedialny

MK2: zajęcia warsztatowe z obliczeniami przy tablicy

Zasady oceniania zajęć:***Ogólne zasady zaliczania zajęć:***

Zaliczenie zajęć odbywa się w formie pisemnej. Praca pisemna powinna być udostępniona studentowi na jego życzenie, a prowadzący musi ją przechowywać przez okres jednego roku lub do zaliczenia kierunkowego efektu kształcenia.

Warunki otrzymania oceny pozytywnej:

Student powinien

- przynajmniej dostatecznie poznać i zrozumieć podstawową wiedzę zawartą w literaturze podstawowej lub innej formie dostępnej w wyniku aktywnych form zajęć,
- przynajmniej dostatecznie opanować wszelkie umiejętności przewidziane programem przedmiotu,
- wykazać przynajmniej dostateczną umiejętność obserwowania i analizowania otaczających zjawisk, zwłaszcza tych, z którymi jako absolwent będzie miał styczność w praktycznej działalności,
- sprostać wymaganiom przewidzianym dla uzyskania zaliczenia z form towarzyszących przed zaliczeniem formy wiodącej oraz modułu.

Kryteria oceniania:

Prowadzący ustala kryteria oceniania i przedstawia studentom na pierwszych zajęciach. Zasady zaliczenia są zgodne z Regulaminem Studiów; w szczególności musi być spełniony wymóg dotyczący stopnia opanowania programu: 50-59% - ocena dostateczna, 60-69% - ocena dostateczna plus, 70-79% - ocena dobra, 80-89% - ocena dobra plus, powyżej 90% - ocena bardzo dobra.

Sposób weryfikacji efektów kształcenia:***Ocena formująca:***

OF1: obserwacja realizacji zadań podczas zajęć

OF2: obserwacja aktywności podczas zajęć

Ocena podsumowująca:

OP1: kolokwium pisemne podczas zajęć warsztatowych

OP2: kolokwium pisemne z wykładu

Całkowity nakład pracy studenta:

Nakład pracy studenta	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
Łączna liczba godzin pracy studenta:	60	
Liczba godzin kontaktowych (realizowana podczas zajęć):	45	24
Liczba godzin poświęconych na samokształcenie oraz przygotowanie do zajęć:	10	24
Liczba godzin poświęconych na przygotowanie do zaliczenia modułu:	5	12
Łączna liczba punktów ECTS:	2	
Liczba punktów ECTS przypadająca na zajęcia kontaktowe (1):	2	1
Liczba punktów ECTS przypadająca na zajęcia praktyczne (2):	2	2
Procent programu modułu realizowany podczas zajęć z nauczycielem (3):	70%	nie dotyczy

(1) Należy podać całkowitą liczbę punktów ECTS.

(2) Liczba jest wyznaczona na podstawie liczby godzin przypadającej na zajęcia praktyczne (ćwiczenia, warsztaty, projekty itp.) oraz na samokształcenie związane z zajęciami praktycznymi.

(3) Dotyczy tylko studiów stacjonarnych; minimalna wartość jest równa udziałowi liczby godzin kontaktowych w łącznej liczbie godzin pracy studenta.

Tabela odniesień dla modułu kształcenia:

Efekt kształcenia	Odniesienie do efektu	Cele kształcenia	Treści programowe	Metody kształcenia	Sposób weryfikacji efektów kształcenia
-------------------	-----------------------	------------------	-------------------	--------------------	--

	kierunkowego				
EK1	K2FZ_W03 K2FZ_W04 K2FZ_W07	Cel1 Cel2	w1-w6 wt1-wt8	MK1 MK2	OF2, OP1, OP2
EK2	K2FZ_U04 K2FZ_U05 K2FZ_U08	Cel1 Cel2	w2-w6 wt2-wt8	MK1 MK2	OF1, OF2, OP1, OP2

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

Nazwiska osób prowadzących modul: dr Bogumiła Wątopek

Autor programu: dr Bogumiła Wątopek