

## KARTA MODUŁU

### I. OGÓLNE INFORMACJE O MODULE

#### PAŃSTWOWA WYŻSZA SZKOŁA ZAWODOWA IM. WITELONA W LEGNICY WYDZIAŁ NAUK TECHNICZNYCH I EKONOMICZNYCH

<b>Kierunek studiów:</b>	<b>Finanse i zarządzanie w przedsiębiorstwie</b>					
<b>Poziom studiów:</b>	studia drugiego stopnia					
<b>Profil studiów:</b>	praktyczny					
<b>Forma studiów:</b>	stacjonarne/niestacjonarne					
<b>Nazwa modułu:</b>	<b>Portfel inwestycyjny</b>					
<b>Rodzaj modułu:</b>	Obowiązkowy					
<b>Język wykładowy:</b>	Język polski*					
<b>Rok studiów:</b>	<b>1</b>	<b>Formy prowadzenia zajęć wraz z liczbą godzin dydaktycznych:</b>				
<b>Semestr:</b>	<b>2</b>	Wykład	Ćwiczenia	Warsztat	Projekt	Seminarium
<b>Liczba punktów ECTS ogółem:</b>	<b>3</b>	15/10	-	30/14	-	-
<b>Forma zaliczenia:</b>	Zaliczenie na ocenę					
<b>Wymagania wstępne:</b>	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
<b>wiedzy:</b>			
W01	Ma wiedzę na temat metod konstrukcji i oceny portfeli inwestycyjnych	K2FZ_W01 K2FZ_W03	Kolokwium zaliczeniowe
<b>umiejętności:</b>			
U01	Potrafi konstruować portfele inwestycyjne, ograniczać i dywersyfikować ryzyko inwestycyjne	K2FZ_W03	Kolokwium zaliczeniowe
<b>kompetencji społecznych:</b>			
-	-	-	-

### 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	3/2
w6	Ocena efektywności portfela inwestycyjnego	2/1
<b>Warsztaty</b>		
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	4/2
wt8	Portfel inwestycyjny funduszy emerytalnych, banków, zakładów ubezpieczeń	2/1
<b>V. METODY KSZTAŁCENIA, NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE</b>		
<p><b>1. Metody kształcenia:</b> wykład multimedialny zajęcia warsztatowe z obliczeniami przy tablicy</p> <p><b>2. Narzędzia (środki) dydaktyczne:</b> tablica multimedialna</p>		
<b>VI. FORMA I KRYTERIA ZALICZENIA MODUŁU</b>		
<p><b>Forma zaliczenia modułu</b> Zaliczenie na ocenę</p> <p><b>Kryteria oceny formującej***:</b> obserwacja realizacji zadań podczas zajęć obserwacja aktywności podczas zajęć</p> <p><b>Kryteria oceny podsumowującej***</b></p> <p><b>Kolokwia pisemne</b> 50-59% - ocena dostateczna 60-69% - ocena dostateczna plus 70-79% - ocena dobra 80-89% - ocena dobra plus powyżej 90% - ocena bardzo dobra</p> <p><b>Ocena podsumowująca***:</b> Ocena z modułu: średnia ocen z poszczególnych form zajęć</p>		
<b>VII. BILANS PUNKTÓW ECTS - NAKŁAD PRACY STUDENTA</b>		
<b>Kategoria</b>	<b>Obciążenie studenta (S/N)</b>	
<b>Liczba godzin realizowanych przy bezpośrednim udziale nauczyciela (godziny kontaktowe)</b>	<b>45/24</b>	
Udział w wykładach	15/10	
Udział w innych formach zajęć (**)	30/14	
Inne: udział w egzaminie	-	
<b>Samodzielna praca studenta (godziny niekontaktowe)</b>	<b>30/51</b>	
Przygotowanie do wykładu	14/25	
Przygotowanie do innych form zajęć (**)	12/22	
Przygotowanie do egzaminu	-	

Przygotowanie do zaliczenia innych zajęć (**)	4
Inne (np. gromadzenie materiałów do projektu, kwerenda internetowa, opracowanie prezentacji multimedialnej itp.)	-
<b>Łączna liczba godzin</b>	<b>75</b>
<b>Punkty ECTS za moduł</b>	<b>3</b>

### 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