

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	BUDOWA PORTFELA INWESTYCYJNEGO		
AG/O/II/ST/B35b			CONSTRUCTION OF AN INVESTMENT PORTFOLIO		
Język wykładowy		Polski			
Rok akademicki		2023/2024			
Kierunek		Analityka gospodarcza			
w zakresie		-			
Poziom studiów		studia drugiego stopnia			
Profil studiów		ogólnoakademicki,			
Forma studiów		studia stacjonarne			
Semestr / semestry		trzeci			
Przynależność do grupy zajęć		Grupa zajęć kierunkowych obieralnych B2			
Status przedmiotu		Obieralny			
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS	
		Wykład	[h]	2 ECTS	
		Ćwiczenia	[h]		
		Konwersatorium	30 [h]		
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse			1,5 ECTS
	z uprawnieniami	-----			ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse			2ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość			
Wymagania wstępne		Wszyscy studenci kierunku Analityka gospodarcza, którzy wybiorą dany przedmiot			
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych			
Koordynator		Dr Zbigniew Śleszyński			
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl			
Adres e-mail, telefon koordynatora		z.sleszynski@uthrad.pl , (48) 361-7463			

EFEKTY UCZENIA SIĘ, TREŚCI PROGRAMOWE, REALIZACJA ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH, WERYFIKACJA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ

Cel kształcenia:	Celem zajęć z przedmiotu jest praktyczne zastosowanie metod konstrukcji i analizy portfela papierów wartościowych w oparciu o dane fikcyjne oraz historyczne z GPW w Warszawie
Treści programowe:	<p>Treść przedmiotu:</p> <ul style="list-style-type: none"> Wyznaczanie stopy zwrotu, szacowanie różnych miar ryzyka pojedynczych akcji, (4h, W1, U2) Wyznaczanie stopy zwrotu i ryzyka portfela, (4h, BN, W1, W2, U1, U2, U2) Wyznaczanie portfela Markowitza (portfel efektywny, o minimalnym ryzyku, optymalny), (4h, BN, W1, W2, U1, U2, U2) Konstrukcja portfeli z krótką sprzedażą, (2 h, BN,, W1, W2, U1, U2) Linia charakterystyczna, współczynnik Beta, portfel Sharpe'a, (4h, BN, W1, W2, U1, U2) Metody wyznaczania portfeli dopuszczalnych (w oparciu o współczynniki zysku względnego, portfel Hellwiga, portfel proporcjonalny itp.) (2 h, BN, W1, W2, U1, U2). Portfel akcji i obligacji (2 h,, W1, W2, U1, U2). Budowa portfeli akcji (z krótką sprzedażą i bez) w oparciu o dane historyczne z GPW w W-wie, analiza uzyskanej stopy zwrotu (6 h, BN, W1, W2, U1, U3, K1, K2). <p>Praca audytoryjna (2h)</p>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	<p>metody podające (wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych z elementami dyskusji);</p> <p>metody praktyczne (pokaz, ćwiczenia analityczne)</p>
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</p> <p>Konwersatorium – suma ocen: 10% aktywność na zajęciach, 90% ocena z kolokwium pisemnego.</p>

Efekty uczenia się dla przedmiotu w odniesieniu do efektów kierunkowych i formy zajęć				Metody weryfikacji efektów uczenia się	
Numer efektu uczenia się	Opis efektów uczenia się dla przedmiotu (PEU) Student, który zaliczył przedmiot (W) zna i rozumie/ (U) potrafi / (K) jest gotów do:	Kierunkowy efekt uczenia się (KEU)	Forma zajęć	Forma weryfikacji (zaliczeń)	Metody sprawdzania i oceny
W1	Zna i rozumie wady i zalety analizy portfelowej	K_W01	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	dyskusja kolokwium pisemne
W2	Zna i rozumie podstawowe metody i modele analizy portfelowej	K_W05	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Dyskusja, kolokwium pisemne
U1	Potrafi, na podstawie notowań giełdowych skonstruować portfel akcji (w tym z krótką sprzedażą), oszacować jego stopę zwrotu i ryzyko, policzyć efekty inwestycji	K_U02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Dyskusja, kolokwium pisemne
U2	potrafi wykorzystać arkusz kalkulacyjny w analizie portfelowej	K_U02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Dyskusja, kolokwium pisemne
U3	potrafi wyznaczyć efektywny portfel akcji i obligacji	K_U02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Dyskusja, kolokwium pisemne
K1	Jest gotów do budowy portfeli papierów wartościowych, zna konsekwencje inwestycji w akcje	K_K02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Ocena aktywności na zajęciach
K2	Jest gotów do przedstawienia znaczenia analizy portfelowej przy decyzjach inwestycyjnych	K_K04	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Ocena aktywności na zajęciach

Literatura i pomoce naukowe	
<ul style="list-style-type: none"> Elder A., Nowińska A., Zawód inwestor giełdowy-Psychologia rynków. Taktyka inwestycyjna. Zarządzanie portfelem, Wydawnictwo Wolters Kluwer Polska-Oficyna 2001. K Jajuga, T Jajuga, Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, , PWN, Warszawa 2015. Kolupa M., Plebaniak J. [2000], Budowa portfela lokat, PWE, Warszawa Kolupa M. [1994], Metoda Z. Hellwiga wyznaczania portfela lokat, Rector's Lectures, nr 20, AE, Kraków Reilly F.K, Brown K.C., Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, tom I, II, PWE, Warszawa 2001. Z. Śleszyński, Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011. Śleszyński Z. [1998] O zależności współczynnika korelacji akcji oraz ich współczynników beta dla jednowskaźnikowych modeli Sharpe'a, Przegląd Statystyczny, Zeszyt 1/1998, PWN, Warszawa. Tarczyński W., Witkowska D., Kompa K., Współczynnik Beta. Teoria i praktyka, Pielaszek Research, Warszawa 2013. Weron A. Weron R. [1999], Inżynieria finansowa Wycena instrumentów pochodnych Symulacje komputerowe Statystyka rynku, Wydawnictwa Naukowo – Techniczne, Warszawa 	

Nakład pracy studenta potrzebny do osiągnięcia zakładanych efektów uczenia się – bilans punktów ECTS			
Udział w zajęciach, aktywność	Obciążenie studenta [h]		
	Inne godz. kontaktowe (IGK)	Zajęcia bez nauczyciela-praca własna studenta (ZBN)	Zajęcia dydaktyczne
Udział w wykładach/konwersatoriach	X	X	30h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X	[h]
Udział w konsultacjach	5[h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	15[h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	15 [h]/ 0,6ECTS	30[h]/ 1,2 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	50 [h] / 2 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
<p>W przypadku studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych, określone powyżej (w karcie) metody i formy weryfikacji efektów uczenia się dostosowuje się odpowiednio do indywidualnych potrzeb tych studentów.</p> <p>Szczegółowe zasady i formy wsparcia studentów ze szczególnymi potrzebami: w tym z niepełnosprawnością, przewlekle chorych podczas zajęć, zaliczeń i egzaminów określono w: Regulaminie Studiów, Zasadach Studiowania, Procedurze dotyczącej zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych.</p>