

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	ZARZĄDZANIE PORTFELEM INWESTYCYJNYM		
E/O/II/ST/B36a			INVESTMENT PORTFOLIO MANAGEMENT		
Język wykładowy		Polski			
Rok akademicki		2024/2025			
Kierunek		Ekonomia			
w zakresie		-			
Poziom studiów		studia drugiego stopnia			
Profil studiów		ogólnoakademicki,			
Forma studiów		studia stacjonarne			
Semestr / semestry		3			
Przynależność do grupy zajęć		B2. Grupa zajęć kierunkowych obieralnych			
Status przedmiotu		Obieralny			
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS	
		Wykład	15 [h]	3 ECTS	
		Ćwiczenia	30[h]		
		Konwersatorium	[h]		
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse			2 ECTS
	z uprawnieniami	-----			ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse			3ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni			
Wymagania wstępne		bez wymagań wstępnych			
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@urad.edu.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>Treści zajęć są powiązane z prowadzonymi badaniami naukowymi.</p> <p>Treść przedmiotu: Wykład:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Wyznaczanie stopy zwrotu, szacowanie różnych miar ryzyka pojedynczych akcji, (• Wyznaczanie stopy zwrotu i ryzyka portfela, • Wyznaczanie portfela Markowitza (portfel efektywny, o minimalnym ryzyku, optymalny) , • Konstrukcja portfeli z krótką sprzedażą, • Linia charakterystyczna, współczynnik Beta, portfel Sharpe'a, • Metody wyznaczania portfeli dopuszczalnych (w oparciu o współczynniki zysku względnego, portfel Hellwiga, portfel proporcjonalny itp.) • Portfel akcji i obligacji <p>Ćwiczenia: Rozwiązywanie praktycznych zadań w nawiązaniu do treści wykładów:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Wyznaczanie stopy zwrotu, szacowanie różnych miar ryzyka pojedynczych akcji, • Wyznaczanie stopy zwrotu i ryzyka portfela • Wyznaczanie portfela Markowitza (portfel efektywny, o minimalnym ryzyku, optymalny) • Konstrukcja portfeli z krótką sprzedażą, • Linia charakterystyczna, współczynnik Beta, portfel Sharpe'a, • Wyznaczanie portfeli dopuszczalnych (w oparciu o współczynniki zysku względnego, portfel Hellwiga, portfel proporcjonalny itp.) • Budowa portfeli akcji (z krótką sprzedażą i bez) w oparciu o dane historyczne z GPW w W-wie, analiza uzyskanej stopy zwrotu,
Metody dydaktyczne (kształcenia):	<p>wykład z wykorzystaniem technik multimedialnych rozwiązywanie zadań metoda ćwiczeniowa metoda przypadków</p> <p>Zajęcia realizowane w pracowni komputerowej z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego Excel</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. Wykład-egzamin pisemny, który ma postać testu jednokrotnego wyboru z karami za niepoprawną odpowiedź. Student otrzymuje 9 pytań do każdego podane 4 odpowiedzi, w tym jedna poprawna, za wskazanie poprawnej odpowiedzi otrzymuje 3 punkty, za brak odpowiedzi 0 punktów, za błędną odpowiedź (-1) punkt. Warunkiem zdania egzaminu jest uzyskanie przynajmniej 11 punktów. Ocena z egzaminu zostanie wystawiona zgodnie z zasadą:</p> <p>10 pkt. i mniej – niedostateczny (2) [11-14] pkt – dostateczny (3) [15-18] pkt – dostateczny plus (3,5) [19-21] pkt – dobry (4)</p>

	<p>[22-24] pkt – dobry plus (4,5)</p> <p>[25-27] pkt – bardzo dobry (5)</p> <p>Warunkiem przystąpienia do egzaminu jest posiadanie zaliczonych ćwiczeń</p> <p>Ćwiczenia – suma ocen: 10% aktywność na zajęciach, 90% ocena z kolokwium pisemnego. Za aktywność można uzyskać 3 punkty, z kolokwium pisemnego 30. Warunkiem zaliczenia ćwiczeń jest uzyskanie łącznie 16 punktów. Ocena z ćwiczeń zostanie wystawiona zgodnie z zasadą:</p> <p>15 pkt. i mniej – niedostateczny (2)</p> <p>[16-20] pkt – dostateczny (3)</p> <p>[21-23] pkt – dostateczny plus (3,5)</p> <p>[24-26] pkt – dobry (4)</p> <p>[27-28] pkt – dobry plus (4,5)</p> <p>[29-33] pkt – bardzo dobry (5)</p> <p>Szczegółowe zasady oraz uprawnienia studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością i przewlekle chorych w zakresie uczestniczenia, przeprowadzania zaliczeń i egzaminów są określone w: Regulaminie studiów, Zasadach studiowania, Procedurze zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością i przewlekle chorych.</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	Wykład ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Egzamin pisemny, kolokwium pisemne
W2	Zna i rozumie podstawowe metody i modele analizy portfelowej		K_W05	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Egzamin pisemny,
W3	Zna i rozumie podstawowe zasady zarządzania portfelem inwestycyjnym		K_W07	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Egzamin pisemny,
U1	Potrafi, na podstawie notowań giełdowych skonstruować portfel akcji (w tym z krótką sprzedażą), oszacować jego stopę zwrotu i ryzyko, policzyć efekty inwestycji, wykorzystać arkusz kalkulacyjny w analizie portfelowej,		K_U01	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Ocena wykonywanych zadań na ćw., kolokwium pisemne, egzamin
U2	Potrafi oszacować efekty inwestycji, wykorzystać arkusz kalkulacyjny w analizie portfelowej,		K_U02	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Ocena wykonywanych zadań na ćw., kolokwium pisemne, egzamin
U3	Potrafi, na podstawie danych historycznych wyznaczyć efektywny portfel akcji i obligacji		K_U06	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Ocena wykonywanych zadań na ćw., kolokwium pisemne, egzamin

K1	Jest gotów do przedstawienia znaczenia analizy portfelowej przy decyzjach inwestycyjnych	K_K04	Wykład, ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Ocena aktywności na zajęciach
----	--	-------	-------------------	---------------------	-------------------------------

Literatura i pomoce naukowe					
Literatura podstawowa:					
<ul style="list-style-type: none"> Elder A. Zawód inwestor giełdowy-Nowe ujęcie, Wydawnictwo Maklerska, 2018. K Jajuga, T Jajuga, Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, , PWN, Warszawa 2024. 					
Literatura uzupełniająca:					
<ul style="list-style-type: none"> Łuniewska M., Tarczyński W., Metody wielowymiarowej analizy porównawczej na rynku kapitałowym, PWN Warszawa 2020. Philip Fischer A. Zwyczajne akcje niezwykle zyski, Wydawnictwo Maklerska, wyd I 2019, (ebook 2024) Tarczyński W., Majewski S., Majewska A., Tarczyńska-Łuniewska M., Analizy rynku kapitałowego. Ujęcie klasyczne i nieklasyczne, Wydawnictwo Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego, Szczecin 2020. Z. Śleszyński, Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011. 					
Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podaje prowadzący					

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	15h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X	30[h]
Udział w konsultacjach	9[h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	21[h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	9 [h]/ 0,4 ECTS	21 [h]/ 0,8 ECTS	45[h]/ 1,8 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	75 [h] / 3 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
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.