

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

## Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	BUDOWA PORTFELA INWESTYCYJNEGO	
IAwB/O/II/NST/B2-29b			CONSTRUCTION OF AN INVESTMENT PORTFOLIO	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2025/2026		
Kierunek		Informatyka i Analityka w Biznesie		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki,		
Forma studiów		studia niestacjonarne		
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	15[h]	
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse		ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse		2 ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni		
Wymagania wstępne		Znajomość algebry liniowej, metod optymalizacyjnych		
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><b>Treść przedmiotu:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Wyznaczanie stopy zwrotu, szacowanie różnych miar ryzyka pojedynczych akcji, (</li> <li>• Wyznaczanie stopy zwrotu i ryzyka portfela,</li> <li>• Wyznaczanie portfela Markowitza (portfel efektywny, o minimalnym ryzyku, optymalny) ,</li> <li>• Konstrukcja portfeli z krótką sprzedażą,</li> <li>• Linia charakterystyczna, współczynnik Beta, portfel Sharpe'a,</li> <li>• Metody wyznaczania portfeli dopuszczalnych (w oparciu o współczynniki zysku względnego, portfel Hellwiga, portfel proporcjonalny itp.)</li> <li>• Portfel akcji i obligacji</li> </ul>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	<p>konwersatorium z wykorzystaniem technik multimedialnych rozwiązywanie zadań metoda ćwiczeniowa metoda przypadków obserwacja 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. Uzyskanie pozytywnych ocen ze wszystkich form zajęć wchodzących w skład danego przedmiotu jest równoznaczne z jego zaliczeniem i zdobyciem przez studenta liczby punktów ECTS przyporządkowanej temu przedmiotowi. Sposób obliczenia oceny końcowej z przedmiotu określony został zarządzeniem Rektora URad</p> <p>Konwersatorium-na ocenę końcową składają się: zaliczenie pisemne, które ma postać testu jednokrotnego wyboru Student otrzymuje 9 pytań do każdego podane 4 odpowiedzi, w tym jedna poprawna, za wskazanie poprawnej odpowiedzi otrzymuje 1 punkt, za brak odpowiedzi lub odpowiedź niepoprawną 0 punktów, Warunkiem zaliczenia testu jest uzyskanie minimum 5 punktów . projekt – zbudowane portfele akcji przynajmniej 10 spółek w oparciu o dane historyczne i różne metody- oceniany na do 5 pkt, próg zaliczenia 3 pkt. Poziom realizacji kompetencji społecznych- 3 pkt. Ocena stopnia osiągnięcia wymaganych kompetencji społecznych jest wynikiem oceny przeprowadzanej przez prowadzącego zajęcia na podstawie: - oceny aktywności studenta na zajęciach, - oceny na podstawie obserwacji bezpośredniej elementów: komunikacja, współpraca, rozwiązywanie problemów. Łącznie z konwersatorium student może uzyskać 19 punktów. Ocena końcowa zostanie wystawiona zgodnie z zasadą: 9 pkt. i mniej – niedostateczny (2) 10, 11 pkt – dostateczny (3) 12, 13 pkt – dostateczny plus (3,5) 14, 15 pkt – dobry (4) 16, 17 pkt – dobry plus (4,5) 18-19 pkt – bardzo dobry (5) Ocena końcowa z konwersatorium może zostać podwyższona o 0,5 stopnia w sytuacji wysokiej aktywności studenta podczas zajęć.</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_W06	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_U03	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Dyskusja, kolokwium pisemne, projekt
U2	potrafi wykorzystać arkusz kalkulacyjny w analizie portfelowej		K_U04	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	kolokwium pisemne, projekt
K1	Jest gotów do budowy portfeli papierów wartościowych, zna konsekwencje inwestycji w akcje		K_K02	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Obserwacja, aktywność na zajęciach
K2	Jest gotów do przedstawienia znaczenia analizy portfelowej przy decyzjach inwestycyjnych		K_K03	Konwersatorium	Zaliczenie na ocenę	Obserwacja, aktywność na zajęciach

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

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	15[h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X	x
Udział w konsultacjach	5[h]	X	X
Przygotowanie do konwersatorium 10[h] Przygotowanie projektu 20[h]	X	30[h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	30 [h]/ 1,2 ECTS	16[h]/ 0,6 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>