

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	Budowa portfela inwestycyjnego	
AlwB/O/II/ST/B2-28b			Building an investment portfolio	
Język wykładowy		polski		
Rok akademicki		2026/27		
Kierunek		Sztuczna Inteligencja w Biznesie		
w zakresie		-		
Poziom studiów		Studia drugiego stopnia		
Profil studiów		Profil ogólnoakademicki		
Forma studiów		Studia stacjonarne		
Semestr / semestry		III		
Przynależność do grupy zajęć		B2. Grupa zajęć kierunkowych obieranych		
Status przedmiotu		obieralny		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		konwersatorium	30 [h]	3 ECTS
			[h]	
			[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		3 ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne		Podstawy dotyczące rynków finansowych i instrumentów finansowych, analizy i wyceny instrumentów finansowych		
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
Koordynator		Dr Joanna Bukowska, prof. URad.		
Adres strony internetowej pjo		www.weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail, telefon koordynatora		j.bukowska@urad.edu.pl		

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:	Treść konwersatorium: <ol style="list-style-type: none"> 1. Wyznaczanie stopy zwrotu, szacowanie różnych miar ryzyka pojedynczych akcji, 2. Wyznaczanie stopy zwrotu i ryzyka portfela, 3. Wyznaczanie portfela Markowitza (portfel efektywny, o minimalnym ryzyku, optymalny), 4. Konstrukcja portfeli z krótką sprzedażą, 5. Linia charakterystyczna, współczynnik Beta, portfel Sharpe'a, 6. Metody wyznaczania portfeli dopuszczalnych (w oparciu o współczynniki zysku względnego, portfel Hellwiga, portfel proporcjonalny itp.), 7. Portfel akcji i obligacji
Metody dydaktyczne (kształcenia):	Konwersatorium z wykorzystaniem technik multimedialnych, rozwiązywanie zadań, metoda ćwiczeniowa, metoda przypadków, obserwacja. Zajęcia realizowane w pracowni komputerowej z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego Excel
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p>Warunkiem uzyskania zaliczenia jest osiągnięcie przez studenta wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</p> <p>Konwersatorium - suma ocen: 30% poziom realizacji kompetencji społecznych, 70% projekt</p> <p>Ocena stopnia osiągnięcia wymaganych kompetencji społecznych jest wynikiem oceny przeprowadzanej przez prowadzącego zajęcia na podstawie:</p> <ul style="list-style-type: none"> – oceny aktywności studenta na zajęciach (ocena końcowa z konwersatorium może zostać podwyższona o 0,5 stopnia w sytuacji wysokiej aktywności studenta podczas zajęć), – oceny na podstawie obserwacji bezpośredniej elementów: komunikacja, współpraca, rozwiązywanie problemów.

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 w pogłębionym i uporządkowanym stopniu zasady funkcjonowania rynku giełdowego i pozagiełdowego oraz role podmiotów uczestniczących w podejmowanych na nim transakcjach. Zna i rozumie wady i zalety budowy portfela inwestycyjnego.	K_W03	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	projekt
W2	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu metody i modele analizy portfelowej.	K_W04	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	projekt
U1	Potrafi, na podstawie notowań giełdowych skonstruować portfel akcji (w tym z krótką sprzedażą), oszacować jego stopę zwrotu i ryzyko, policzyć efekty inwestycji	K_U04	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	projekt
U2	Potrafi skonstruować rozbudowany portfel inwestycyjny oparty na wielu instrumentach finansowych. Oszacować dochód i ryzyko z inwestycji w wyznaczony portfel inwestycyjny. Potrafi wykorzystać arkusz kalkulacyjny w analizie portfelowej	K_U03	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	projekt

K1	Jest gotów do budowy portfeli papierów wartościowych, zna konsekwencje inwestycji w akcje. Jest gotów do przedstawienia znaczenia analizy portfelowej przy decyzjach inwestycyjnych.	K_K03	konwersatorium	zaliczenie na ocenę	obserwacja, aktywność na zajęciach
----	--	-------	----------------	---------------------	------------------------------------

Literatura i pomoce naukowe					
Literatura podstawowa:					
1. K Jajuga, T Jajuga, Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, , PWN, Warszawa 2024.					
2. M. Łuniewska, W. Tarczyński, Metody wielowymiarowej analizy porównawczej na rynku kapitałowym, PWN Warszawa 2020.					
Literatura uzupełniająca:					
1. P. Fischer, Zwyczajne akcje niezwykle zyski, Wydawnictwo Maklerska, wyd I 2019, (ebook 2024)					
2. Elder, Zawód inwestor giełdowy - Nowe ujęcie, Wydawnictwo Maklerska, 2018.					
3. Z. Śleszyński, Portfel wyznaczony w warunkach krótkiej sprzedaży. Teoria i praktyka, Wydawnictwo Politechniki Radomskiej, Radom 2011.					

Nakład pracy studenta potrzebny do osiągnięcia zakładanych efektów uczenia się – bilans punktów ECTS		
Udział w zajęciach, aktywność	Obciążenie studenta [h]	
	Praca własna studenta - zajęcia bez nauczyciela (ZBN)	Zajęcia dydaktyczne
Udział w konwersatorium	X	30 [h]
Przygotowanie do zajęć, Przygotowanie do zaliczenia	45 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	45 [h]/ 1,8 ECTS	30 [h]/ 1,2 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	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. 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.