

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

I. OGÓLNE INFORMACJE PODSTAWOWE O PRZEDMIOCIE (MODULE)											
<b>Portfel inwestycyjny</b>											
Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej kierunek:				Uczelnia Biznesu i Nauk Stosowanych „Varsovia” w Warszawie							
Nazwa kierunku studiów, poziom kształcenia:				Finanse i rachunkowość, studia II stopnia							
Liczba punktów ECTS				3							
Język przedmiotu- polski, angielski, inny				polski							
Profil kształcenia:				PRAKTYCZNY							
Nazwa specjalności:				Controlling inwestycyjny							
Rodzaj modułu kształcenia: (wskazać właściwe)				Podstawowy / kierunkowy/ <u>specjalnościowy</u> /obowiązkowy/ fakultatywny							
Rok / Semestr:				II/3							
Osoba koordynująca przedmiot:				Koordynator kierunku							
Wymagania wstępne (wynikające z następstwa przedmiotów):				Zaliczone przedmioty kierunkowe z semestru 1-2							
II. FORMY ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH ORAZ WYMIAR GODZIN											
	Wykład	Ćwiczenia/ kwersatoriu m	Laboratoriu m	Warsztaty	Projekt	Seminarium	Praktyki	Ko	Egzamin / zaliczenie	Suma godzin	Ogółem ECTS
Studia stacjonarne		50			6			4	2	62	3
Studia niestacjonarne		20			6			4	3	33	3
III. METODY REALIZACJI ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH											
Formy zajęć				Metody dydaktyczne (właściwe podkreślić)							
Wykład/ <u>Ćwiczenia</u> / <u>Warsztat</u> / <u>Projekt</u> / Laboratorium				Wykład z dyskusją ukierunkowaną wykład z prezentacją multimedialną <u>case study.</u> <u>metoda sytuacyjna.</u> <u>metoda projektów.</u> <u>dyskusja dydaktyczna.</u> <u>Ćwiczenia rachunkowe</u> Ćwiczenia z wykorzystaniem narzędzi informatycznych - edukacyjna gra Gra symulacyjna Drama Inne							
IV. PRZEDMIOTOWE EFEKTY UCZENIA SIĘ Z ODNIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKU											
Lp.	Opis przedmiotowych efektów uczenia się									Odniesienie do efektu	

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

		kierunkowego symbol
<b>Wiedza:</b>		
P_W01	Zna cele inwestorów, kryteria i strategie budowy portfela.	K2P_W01 K2P_W04
P_W02	Zna miary stopy zwrotu, ryzyka i zależności	K2P_W04 K2P_W07
P_W03	Zna klasyczne modele budowy portfela	K2P_W04 K2P_W07
P_W04	Zna podstawowe rozszerzenia i modele alternatywne	K2P_W04, K2P_W07
P_W05	Zna miary efektywności zarządzania portfelem	K2P_W04, K2P_W07
P_W06	Zna metody dywersyfikacji i zabezpieczenia portfela w tym z zastosowanie instrumentów pochodnych	K2P_W04, K2P_W07
P_W07	Zna rodzaje inwestycji alternatywnych	K2P_W04, K2P_W07
<b>Umiejętności:</b>		
P_U01	Potrafi dokonać wyboru odpowiednich danych rynkowych, dostosować je oraz policzyć ich podstawowe statystyki.	K2P_U05
P_U02	Potrafi zbudować portfel instrumentów udziałowych z zastosowaniem różnych modeli	K2P_U05
P_U03	Potrafi zbudować portfele instrumentów dłużnych	K2P_U05
P_U04	Potrafi oszacować parametry modeli i dokonać ich interpretacji	K2P_U01 K2P_U05
P_U05	Potrafi dokonać oceny efektywności zarządzania portfelem z zastosowaniem różnych metod	K2P_U05
<b>Kompetencje społeczne:</b>		
P_K01	Jest gotów samodzielnie rozwijać wiedzę i umiejętności w zakresie zarządzania portfelem inwestycyjnym.	K2P_K02
P_K02	Jest gotów dyskutować w grupie i proponować rozwiązania w zakresie wyboru inwestycji oraz oceny jakości zarządzania	K2P_K03
P_K03	Jest gotów zaprezentować otrzymane wyniki i argumentować zasadność podjętych decyzji inwestycyjnych	K2P_K03
P_K04	Jest gotów krytycznie odnosić się do stosowanych modeli oraz wskazywać ich wady i ograniczenia	K2P_K01
<b>V. TREŚCI KSZTAŁCENIA</b>		
<b>Lp.</b>	<b>Ćwiczenia/Projekt/Laboratorium (właściwe wybrać)</b>	<b>Odniesienie do przedmiotowych efektów uczenia się</b>
T1	Wstęp do teorii portfela i miary wartości oczekiwanej stóp zwrotu, ryzyka oraz zależności	P_W01-P_W02, P_U01, P_K03
T2	Klasyczna teoria portfelowa - model Markowitza i Tobina	P_W03, P_U02, P_U04, P_K02, P_K04

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

T3	Portfel instrumentów dłużnych	P_W03, P_U03, P_K02-P_K04
T4	Teoria użyteczności i wybór portfela optymalnego	P_W03, P_U02, P_U04, P_K01, P_K02, P_K04
T5	Modele liniowe (jednowskaźnikowy, CAPM, APT)	P_W03, P_U01, P_U02, P_U04, P_K01, P_K03, P_K04
T6	Nieklasyczne modele budowy portfela inwestycyjnego	P_W05, P_U02, P_U04, P_K01, P_K03, P_K04
T7	Ocena efektywności portfela	P_W05, P_U05, P_K01-P_K03
T8	Alokacja aktywów	P_W01, P_W06, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
T9	Instrumenty pochodne w portfelu	P_W06, P_U04, P_K01-P_K03
T10	Dywersyfikacja międzynarodowa	P_W06, P_U01- P_U02, P_K01- P_K03
T11	Inwestycje alternatywne w portfelu	P_W07, P_U01- P_K01-P_K03
P1	Case studies	P_W01-P_W07, P_U01-P_U05, P_K01-P_K04

## VI. METODY WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ

<b>Forma zajęć, w ramach której weryfikowany jest EU</b>	<b>Metoda weryfikacji (WŁAŚCIWE WYBRAĆ)</b> <b>Egzamin pisemny, egzamin ustny, kolokwium, projekt, prezentacja, referat, esej inne</b>	<b>Kategoria weryfikowanych efektów uczenia się:</b> <b>wiedza, umiejętności, kompetencje społeczne</b> <b>WŁAŚCIWE WYBRAĆ</b>
--	---	--

Ćwiczenia	Kolokwium zaliczeniowe w formie testu złożonego z pytań zamkniętych z jedną poprawną odpowiedzią	P_W01-P_W07, P_U01- P_U05, P_K01-P_K04
Projekt	Projekt realizowany w grupach.	P_W01-P_W07, P_U01- P_U05, P_K01-P_K04

## WARUNKI ZALICZENIA PRZEDMIOTU wskazać właściwe

	Zaliczenie wszystkich form zajęć przedmiotu (Ćwiczeń, projektu, laboratorium, pozytywna ocena egzaminu ....., INNE	
Ćwiczenia	Pozytywna ocena pracy pisemnej	P_W01-P_W07, P_U01- P_U05, P_K01-P_K04
Zajęcia projektowe	Pozytywna ocena projektu i aktywności na zajęciach	P_W01-P_W07, P_U01- P_U05, P_K01-P_K04

## VIII. NAKŁAD PRACY STUDENTA – WYMIAR GODZIN I BILANS PUNKTÓW ECTS

Rodzaj aktywności ECTS	Obciążenie studenta	
	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
1.Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów dydaktycznych (wykłady, ćwiczenia, konwersatoria, projekt,	62	33

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Załącznik nr 1

laboratoria, warsztaty, seminaria) – <b>SUMA godzin</b> – z punktu II		
W tym		
1.1. Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów	56	26
1.2. Egzaminy/zaliczenia -liczba godzin	2	3
1.3. Udział w konsultacjach -liczba godzin	4	4
2.– Indywidualna praca własna studenta - liczba godzin – Projekt / esej / studium przypadku / zadanie praktyczne, samodzielne przygotowanie się do zajęć, egzaminów, zaliczeń	13	42
<b>Sumaryczne obciążenie pracą studenta (25h = 1 ECTS) SUMA godzin i ECTS</b>	<b>75/3</b>	<b>75/3</b>

## IX. LITERATURA PRZEDMIOTU ORAZ INNE MATERIAŁY DYDAKTYCZNE

### Literatura podstawowa przedmiotu:

Truskowski J., Perez K, 2020, Portfel inwestycyjny, Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu

Ostrowska E., 2020, Behawioralny portfel inwestycyjny. Mózg – emocje – luka behawioralna, Wydawnictwo Uniwersytetu Gdańskiego

### Literatura uzupełniająca przedmiotu:

Inwestycje, Instrumenty finansowe, Aktywa niefinansowe, Ryzyko finansowe, Inżynieria finansowa, Jajuga K., Jajuga T., Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2007

Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, Elton E.J., Gruber M.J., WIG PRESS, Warszawa, 1998

Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, Reilly F.K., Brown K.C., PWE, Warszawa, 2001

Managing Investment Portfolios, Maginn J., Tuttle D., McLeavey D., Pinto J., John Wiley & Sons, Hoboken, 2007

### Inne materiały dydaktyczne:

# **KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)**

Załącznik nr 1