

I. OGÓLNE INFORMACJE PODSTAWOWE O PRZEDMIOCIE (MODULE)

Zarządzanie portfelem inwestycyjnym

Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej kierunek:	Uczelnia Biznesu i Nauk Stosowanych „Varsovia”
Nazwa kierunku studiów, poziom kształcenia:	ZARZĄDZANIE, studia II stopnia
Liczba punktów ECTS	3
Język przedmiotu- polski, angielski, inny	polski
Profil kształcenia:	PRAKTYCZNY
Nazwa specjalności:	Kryptowaluty w biznesie
Rodzaj modułu kształcenia: (wskazać właściwe)	Podstawowy / kierunkowy/ <u>specjalnościowy</u> /obowiązkowy/fakultatywny
Rok / Semestr:	II/4
Osoba koordynująca przedmiot:	Koordinator kierunku
Wymagania wstępne (wynikające z następnstwa przedmiotów):	Przedmioty kierunkowe z semestrów 1-3

II. FORMY ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH ORAZ WYMIAR GODZIN

	Wykład	Ćwiczenia/konwersatorium	Laboratorium	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/Ćwiczenia/Warsztat/ <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 ODNIESIENIEM DO EFEKTÓW KIERUNKU

Lp.	Opis przedmiotowych efektów uczenia się	Odniesienie do efektu kierunkowego symbol
Wiedza:		
P_W01	Zna w pogłębionym stopniu miary wartości oczekiwanej stóp zwrotu, zna podstawowe miary ryzyka i zależności, cele inwestorów, strategie oraz kryteria budowy portfela inwestycyjnego	K2P_W01 K2P_W02 K2P_W04
P_W02	Zna w pogłębionym stopniu model budowy portfela akcji - model Markowitza, rozumie ideę dywersyfikacji ryzyka oraz zna model portfela składającego się z akcji i instrumentów dłużnych - model Tobina	K2P_W01 K2P_W02 K2P_W04

P_W03	Zna w pogłębionym stopniu założenia, budowę i interpretację parametrów modelu jednowskaźnikowego; CAPM, zna miary oceny efektywności portfeli na podstawie danych historycznych	K2P_W01 K2P_W02 K2P_W04
Umiejętności:		
P_U01	Potrafi zgromadzić dane i oszacować oczekiwaną stopę zwrotu, miary ryzyka i liniowej korelacji dla instrumentów finansowych, zbudować portfel akcji korzystając z różnych metod i kryteriów dla określonego inwestora	K2P_U01 K2P_U02 K2P_U04 K2P_U10
P_U02	Potrafi zbudować portfel składający się z akcji i instrumentów dłużnych, oszacować model jednowskaźnikowy i zinterpretować wartości parametrów, ocenić efektywność zarządzania portfelem i wskazać metody poprawy efektywności	K2P_U01 K2P_U02 K2P_U04 K2P_U10
P_U03		
Kompetencje społeczne:		
P_K01	Jest gotów do działania w sposób przedsiębiorczy uwzględniając uwarunkowania ekonomiczne i prawne, a także społeczne w zakresie zarządzania portfelem inwestycyjnym	K2P_K05
P_K02	Jest gotów do przestrzegania zasad etyki w procesach zarządzania portfelem inwestycyjnym	K2P_K07
V. TREŚCI KSZTAŁCENIA		
Lp.	Ćwiczenia/Projekt/Laboratorium (właściwe wybrać)	Odniesienie do przedmiotowych efektów uczenia się
T1	Cele inwestycyjne, strategie i kryteria budowy portfela inwestycyjnego; inwestorzy indywidualni i instytucjonalni	P_W01, P_K01
T2	Miary wartości oczekiwanej stóp zwrotu, ryzyka i zależności	P_W01, P_K01
T3	Model Markowitza, portfele efektywne, portfel o minimalnej wariancji dla dwóch składników	P_W01-P_W02, P_U01, P_K02
T4	Model Markowitza, portfele efektywne, portfel o minimalnej wariancji dla wielu składników, inne kryteria budowy portfela	P_W01-P_W02, P_U01, P_K01- P_K02
T5	Model Tobina. Modele równowagi rynków finansowych, model CAPM. Miary ocena efektywności portfela inwestycyjnego	P_W01-P_W03, P_U02, P_K02
T6	Case study – budowa portfela kryptowalut	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
P1	Case studies portfele inwestycyjne i ich budowa	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
VI. METODY WERYFIKACJI EFEKTÓW UCZENIA SIĘ		
Forma zajęć, w ramach której weryfikowany jest EU	Metoda weryfikacji (WŁAŚCIWE WYBRAĆ) Egzamin pisemny, egzamin ustny, kolokwium, projekt, prezentacja, referat, esej inne	Kategoria weryfikowanych efektów uczenia się: wiedza, umiejętności, kompetencje społeczne WŁAŚCIWE WYBRAĆ
Ćwiczenia	Praca zaliczeniowa	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
Zajęcia projektowe	Projekt – case studies	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
WARUNKI ZALICZENIA PRZEDMIOTU wskazać właściwie		
	Zaliczenie wszystkich form zajęć przedmiotu (Ćwiczeń, projektu, laboratorium, pozytywna ocena egzaminu, INNE	
Ćwiczenia	Pozytywnie zaliczona praca pisemna	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02
Zajęcia projektowe	Pozytywnie zaliczony projekt, ocena pracy w grupie,	P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02

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, laboratoria, warsztaty, seminaria) – SUMA godzin – z punktu II	62	33
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
Sumaryczne obciążenie pracą studenta (25h = 1 ECTS) SUMA godzin i ECTS	75/3	75/3

IX. LITERATURA PRZEDMIOTU ORAZ INNE MATERIAŁY DYDAKTYCZNE

Literatura podstawowa przedmiotu:

Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje, instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2015
 Ostrowska E., 2015, Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H. Beck, Warszawa
 Rynki finansowe. Organizacja instytucje uczestnicy opracowanie zbiorowe C.H.Beck 2021
 Czapiewski P., Niedziółka P., Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, Diffin, 2016

Literatura uzupełniająca przedmiotu:

Reilly F.K., Brown K.C., Analysis of investments and management of portfolios. South-Western - Cengage Learning, Mason, OH, 2009
 Rubenstein D.M., Inwestorzy. Inspirujące rozmowy z mistrzami, Literanova, 2023
 Fama, E.F., French K.R., 2015, A five-factor asset pricing model, Journal of financial Economics, Vol. 116, pp. 1-22

Inne materiały dydaktyczne: