

I. OGÓLNE INFORMACJE PODSTAWOWE O PRZEDMIOCIE (MODULE)

Zarządzanie portfelem

| | |
|--|--|
| Nazwa jednostki organizacyjnej prowadzącej kierunek: | Uczelnia Biznesu i Nauk Stosowanych „Varsovia” |
| Nazwa kierunku studiów, poziom kształcenia: | ZARZĄDZANIE, studia I stopnia |
| Liczba punktów ECTS | 4 |
| 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: | III/6 |
| Osoba koordynująca przedmiot: | Koordynator przedmiotu |
| Wymagania wstępne (wynikające z następstwa przedmiotów): | Zaliczone przedmioty: finanse |

II. FORMY ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH ORAZ WYMIAR GODZIN

| | Wykład | Ćwiczenia/konwersatorium | Laboratorium | Warsztaty | Projekt | Seminarium | Praktyki | Ko | Egzamin / zaliczenie | Suma godzin | Ogółem ECTS |
|-----------------------|--------|--------------------------|--------------|-----------|---------|------------|----------|----|----------------------|-------------|-------------|
| Studia stacjonarne | | 20 | | | 4 | | | 4 | 2 | 30 | 4 |
| Studia niestacjonarne | | 17 | | | 4 | | | 4 | 2 | 27 | 4 |

III. METODY REALIZACJI ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH

| Formy zajęć | Metody dydaktyczne (właściwe podkreślić) |
|--|--|
| Wykład/ <u>Ćwiczenia</u> /Warsztat/ <u>Projekt</u> / Laboratorium | Wykład z dyskusją ukierunkowaną wykład z prezentacją multimedialną <u>case study</u> , metoda sytuacyjna, <u>metoda projektów</u> , <u>dyskusja dydaktyczna</u> , Ćwiczenia rachunkowe <u>Ćwiczenia z wykorzystaniem narzędzi informatycznych</u> - 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: w zaawansowanym stopniu | | |
| P_W01 | Zna miary wartości oczekiwanej stóp zwrotu, zna podstawowe miary ryzyka i zależności, cele inwestorów, strategie oraz kryteria budowy portfela | KIP_W01 KIP_W02 |

| | | |
|--|---|--|
| | | K1P_W03 |
| P_W02 | Zna podstawowy model budowy portfela akcji - model Markowitza, rozumie ideę dywersyfikacji ryzyka oraz zna model portfela składającego się z akcji i instrumentów dłużnych - model Tobina | K1P_W01 K1P_W02 K1P_W03 |
| P_W03 | Zna założenia, budowę i interpretację parametrów modelu jednowskaźnikowego; CAPM, zna miary oceny efektywności portfeli na podstawie danych historycznych | K1P_W01 K1P_W02 K1P_W03 |
| 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 | K1P_U01 K1P_U04 K1P_U06 |
| 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 | K1P_U01 K1P_U04 K1P_U06 |
| Kompetencje społeczne: | | |
| P_K01 | Jest gotów do działania w sposób przedsiębiorczy uwzględniając uwarunkowania ekonomiczne i prawne, a także społeczne w zakresie zarządzania portfelem | K1P_K05 |
| P_K02 | Jest gotów przekonująco wyjaśnić różnice w zakresie wartości oczekiwanej i zrealizowanej stopy zwrotu z portfela, dyskutować na temat oceny efektywności portfela i krytycznie odnosić się do wykorzystanych metod i uzyskanych wyników | K1P_K01 |
| V. TREŚCI KSZTAŁCENIA | | |
| Lp. | Ćwiczenia/projekt | Odniesienie do przedmiotowych efektów uczenia się |
| C1 | Cele inwestycyjne, strategie i kryteria budowy portfela inwestycyjnego; inwestorzy indywidualni i instytucjonalni | P_W01, P_K01 |
| C2 | Miary wartości oczekiwanej stóp zwrotu, ryzyka i zależności | P_W01, P_K01 |
| C3 | Model Markowitza, portfele efektywne, portfel o minimalnej wariancji dla dwóch składników | P_W01-P_W02, P_U01, P_K02 |
| C4 | 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 |
| C5 | Model Tobina. Modele równowagi rynków finansowych, model CAPM. Miary ocena efektywności portfela inwestycyjnego | P_W01-P_W03, P_U02, P_K02 |
| P | Case study – budowa portfela kryptowalut | 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 | Test wiedzy / praca pisemna | P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02 |
| Projekt | Case studies | P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02 |
| WARUNKI ZALICZENIA PRZEDMIOTU wskazać właściwe | | |

| | | |
|-----------|--|---------------------------------------|
| | Zaliczenie wszystkich form zajęć przedmiotu (Ćwiczeń, projektu, laboratorium, pozytywna ocena egzaminu, INNE | |
| Ćwiczenia | Pozytywna ocena testu wiedzy i projektu, pozytywna ocena aktywności na zajęciach | P_W01-P_W03, P_U01-P_U02, P_K01-P_K02 |
| Projekt | Pozytywna ocena projektu, pozytywna ocena aktywności na zajęciach | 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 | 30 | 27 |
| W tym | | |
| 1.1. Udział w zajęciach z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego i studentów | 24 | 21 |
| 1.2. Egzaminy/zaliczenia - liczba godzin | 2 | 2 |
| 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 | 70 | 73 |
| Sumaryczne obciążenie pracą studenta (25h = 1 ECTS) SUMA godzin i ECTS | 100/4 | 100/4 |

IX. LITERATURA PRZEDMIOTU ORAZ INNE MATERIAŁY DYDAKTYCZNE

| |
|---|
| <p>Literatura podstawowa przedmiotu: Ostrowska E., 2015, Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H. Beck, Warszawa Grzybkowski M., Bentyn S. 2021, Kryptowaluty. Dlaczego jeden bitcoin wart będzie milion dolarów? Crypto-Logic Sp. o.o. Rynki finansowe. Organizacja instytucje uczestnicy opracowanie zbiorowe C.H.Beck 2021 Czapiewski P., Niedziółka P., Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, Diffin, 2016</p> |
| <p>Literatura uzupełniająca przedmiotu: Reilly F.K., Brown K.C., Analysis of investments and management of portfolios. South-Western - Cengage Learning, Mason, OH, 2009 Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje, instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, 2007 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</p> |
| <p>Inne materiały dydaktyczne:</p> |