

Karta przedmiotu

Kierunek: Doradztwo Inwestycyjno-Gospodarcze - studia dualne

Nazwa przedmiotu	Zarządzanie portfelem inwestycyjnym - staż zawodowy					
Język prowadzenia przedmiotu	polski					
Kod/Specjalność	EE-DI-XX-XST1-21/22Z-ZARPTF Brak					
Kategoria przedmiotu	staż					
Profil studiów	Praktyczny					
Poziom PRK	Poziom 6 - 1. stopień (studia licencjackie)					
Rok studiów/semestr	3/5					
Forma zajęć/liczba godzin	stacjonarne:	Staż: 88				
	niestacjonarne:					
Dyscypliny/punkty ECTS	Ekonomia i finanse:		5			
	Inne dyscypliny:		0			
	Razem		5			
Wykładowca odpowiedzialny za przedmiot	Milka Paweł, mgr (Katedra Teorii Ekonomii)					
Cele przedmiotu	Kod	Opis				
	C1	Zapoznanie słuchaczy z teoretycznymi i praktycznymi aspektami pomiaru stopy zwrotu i ryzyka oraz modelami równowagi na rynku kapitałowym.				
	C2	Omówienie teorii portfelowej i zasad zarządzania portfelem inwestycyjnym.				
	C3	Charakterystyka zasad oceny wyników zarządzania portfelem inwestycji.				
Realizowane efekty uczenia się	Kod	Kat.	Opis			
	E1	W	Zna zasady pomiaru stopy zwrotu, rodzaje i zasady oceny ryzyka, założenia i istotę modelu wyceny aktywów kapitałowych (CAPM), teorii wyceny arbitrażowej (APT) oraz modelu jednowskaźnikowego Sharpe'a. Zna założenia i istotę linii rynku papierów wartościowych (SML), potrafi scharakteryzować etapy procesu zarządzania portfelem, strategię zarządzania portfelem oraz umie omówić podstawowe mierniki efektywności zarządzania portfelem inwestycyjnym.			
	E2	U	Potrafi obliczyć stopę zwrotu i ryzyko inwestycji w pojedyncze aktywa i w portfel aktywów, umie zinterpretować i porównać modele równowagi rynku kapitałowego, potrafi obliczyć efektywność zarządzania portfelem inwestycji.			
	E3	K	Jest świadomy występowania różnic w ryzyku aktywów i portfeli inwestycji, potrafi zidentyfikować prawidłowe postępowanie w tworzeniu portfela inwestycji, jest wrażliwy i zorientowany w relacjach ryzyko-stopa zwrotu dla poszczególnych aktywów.			
			Kierunkowe efekty uczenia się WE-ST1-DI-W01-21/22Z WE-ST1-DI-W02-21/22Z WE-ST1-DI-U01-21/22Z WE-ST1-DI-U02-21/22Z WE-ST1-DI-K01-21/22Z WE-ST1-DI-K02-21/22Z			
Sposoby weryfikacji efektów uczenia się	Egzamin ustny, Aktywność na zajęciach, Ćwiczenie praktyczne, Odpowiedź ustna.					
Treści przedmiotu	Staż					
	Kod	Opis	S (88) N ()			
	Z1	Analiza pomiaru stopy zwrotu i ryzyka z inwestycji.	12 0			
	Z2	Analiza linii rynku papierów wartościowych (SML). Model jednowskaźnikowy Sharpe'a. Analiza linii charakterystycznej (CL)	12 0			
	Z3	Model wyceny aktywów kapitałowych (CAPM). Analiza linii rynku kapitałowego (CML). Teoria portfelowa Markowitza. Teoria wyceny arbitrażowej (APT).	12 0			
	Z4	Etapy procesu i strategię zarządzania portfelem aktywów.	12 0			
	Z5	Zarządzanie portfelem inwestycyjnym w praktyce	40 0			
Metody i formy prowadzenia zajęć	Dyskusja, Praca w grupach, Warsztaty.					
Nakład pracy studenta (liczba godzin kontaktowych, pracy on-line i pracy samodzielnej)	Rodzaj aktywności		Liczba godzin			
			stacjonarne niestacjonarne			
	Udział w zajęciach dydaktycznych w bezpośrednim kontakcie z prowadzącym		88 0			
	Udział w konsultacjach		5 0			
	Udział w kolokwium/egzaminie		0 0			
	Praca własna studenta		20 0			
	E-learning		0 0			
	Inne (kontaktowe)		0 0			
	Inne (bezkontaktowe)		12 0			
	Suma godzin		125 0			
	Liczba punktów ECTS		5 0			
Macierz realizacji przedmiotu	Efekt uczenia się	Odniesienie do efektów kierunkowych	Cele przedmiotu	Treści przedmiotu	Metody/narzędzia dydaktyczne	Sposoby weryfikacji efektu
	E1	WE-ST1-DI-W01-21/22Z WE-ST1-DI-W02-21/22Z	C1 C2 C3	Z1 Z2 Z3 Z4 Z5	N4 N5 N14	F3 F8 F9 P1
	E2	WE-ST1-DI-U01-21/22Z WE-ST1-DI-U02-21/22Z	C1 C2 C3	Z1 Z2 Z3 Z4 Z5	N4 N5 N14	F3 F8 F9 P1
	E3	WE-ST1-DI-K01-21/22Z WE-ST1-DI-K02-21/22Z	C1 C2 C3	Z1 Z2 Z3 Z4 Z5	N4 N5 N14	F3 F8 F9 P1
Literatura podstawowa	Lp.	Opis pozycji				
	1	F.K. Reilly, K.C. Brown [2001], Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, PWE, Warszawa.				
	2	H.B. Mayo [2021], Investments: An Introduction, Cengage Learning, Edition: 13th				
	3	K. Jajuga, T. Jajuga [2007], Inwestycje, WN PWN, Warszawa.				
Literatura uzupełniająca	Lp.	Opis pozycji				
	1	H.B. Mayo [2018]. Basic Finance. South-Western College Pub.				
	2	J. Hull [2017], Options, Futures, and Other Derivatives, Wydawnictwo Pearson.				
	3	R.W. Włodarczyk [2017], Międzynarodowe rynki finansowe – współczesne problemy i wyzwania, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Krakowie, Kraków.				
Forma i warunki zaliczenia przedmiotu	Sposób obliczania średniej z ocen bieżących (zgodnie z §18 pkt. 4 Regulaminu studiów)					
	Średnia arytmetyczna ocen bieżących uzyskanych przez studenta w trakcie stażu, obejmujących oceny za realizację zadań powierzonych przez opiekuna stażu					
	Sposób obliczania oceny końcowej (zgodnie z §18 pkt. 5 Regulaminu studiów)					
	Ocena końcowa jest równa średniej ważonej ocen bieżących i egzaminu, tożsamej ze średnią tych ocen ważoną według wag efektów kształcenia. Warunek - wszystkie oceny z efektów kształcenia muszą być pozytywne. Uzyskanie przez Studenta pozytywnej oceny końcowej z przedmiotu możliwe jest w przypadku zrealizowania wszystkich efektów kształcenia w stopniu co najmniej dostatecznym.					
	Dodatkowe informacje o sposobie obliczania oceny końcowej lub egzaminie					
	1. obecność na stażu jest obowiązkowa; 2. wykonywanie poleceń opiekuna stażu;					
Osoby prowadzące przedmiot	Lp.	Nauczyciel				
	1	Włodarczyk Robert, dr hab. (Katedra Teorii Ekonomii)				
	2	Milka Paweł, mgr (Katedra Teorii Ekonomii)				
Informacje dodatkowe						