

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Portfolio Management, PG_00154620						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2025/2026		
Poziom kształcenia	II stopnia		Grupa zajęć		Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	2		Język wykładowy		polski angielski		
Semestr studiów	3		Liczba punktów ECTS		6.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		egzamin		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania -> Katedra Ekonometrii						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr hab. Anna Zamojska				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	30.0	30.0	0.0	0.0	0.0	60
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów		Udział w konsultacjach		Praca własna studenta	RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	60		16.0		74.0	150
Cel przedmiotu	Celem kursu jest przygotowanie studentów do badania czynników wpływających na zwroty aktywów i analizowania ryzyka aktywów. Studenci uczą się, jak badać stopy zwrotów, aby konstruować lepsze portfele i jak używać wskaźników efektywności, aby oceniać wyniki portfela.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRMU2_U01] Rozumie i potrafi prawidłowo interpretować złożone zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości oraz podstawowe w zakresie pozostałych nauk społecznych. Rozumie i umie w pogłębiony sposób wyjaśnić treść komunikatów instytucji gospodarczych, artykułów zamieszczanych w prasie i czasopiśmie z zakresu finansów. Prawidłowo stosuje pojęcia z zakresu nauk społecznych.	Student potrafi prawidłowo uwzględnić w swoich analizach i wypowiedziach aktualne wiadomości z rynku kapitałowego.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_U02] Potrafi wykorzystać zaawansowaną wiedzę teoretyczną do opisu przyczyn i przebiegu procesów i zjawisk ekonomicznych. Potrafi formułować własne opinie krytyczne.	Student potrafi zastosować krytyczne podejście do wyboru modelu teoretycznego w zastosowaniach praktycznych na rynku kapitałowym.	[SU3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna [SU6] demonstracja umiejętności praktycznych
	[FiRMU2_K02] Współpraca: - potrafi harmonijnie współdziałać i pracować w grupie, przyjmując w niej różne role, włączając w to rolę kierowniczą oraz pełnienie nadzoru nad grupą, - potrafi uzgodnić z grupą cele i podział zadań, - jest otwarty, szanuje odmienność innych członków zespołu.	Student potrafi współdziałać i pracować w grupie, jest otwarty na opinie innych i potrafi dyskutować na tematy związane z zarządzaniem portfelem inwestycyjnym.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRMU2_W07] Zna szczegółowo zasady oceny przedsięwzięć w zakresie finansów i rachunkowości (opłacalności projektów inwestycyjnych, oceny sytuacji finansowej organizacji, oceny ryzyka, zagrożenia upadłością). Potrafi zidentyfikować rodzaje ryzyka związanego z działalnością organizacji oraz prawidłowo określić ich konsekwencje i metody ograniczania przy umiejętnym wykorzystaniu wiedzy teoretycznej z zastosowaniem określonej metody badawczej.	Student ma wiedzę w zakresie różnych wskaźników oceny efektywności inwestycji kapitałowych na podstawie szeregów czasowych i przekrojowych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_K04] Uczciwość: - stosuje się do zasad etyki biznesu i podejmuje działania na rzecz przestrzegania tych zasad, - szanuje prawo, - jest obiektywny, potrafi dostrzec konflikt interesów, - prawidłowo identyfikuje i rozstrzyga dylematy związane z wykonywaniem zawodu.	Student zna i stosuje w praktyce zasady etyki biznesu, oraz szanuje obowiązujące prawo.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRMU2_U09] Potrafi posługiwać się językiem obcym na poziomie B2+ Europejskiego Systemu Opisu Kształcenia Językowego oraz specjalistyczną terminologią. Posiada pogłębioną umiejętność przygotowywania prac pisemnych, wystąpień ustnych i prezentacji, w nowożytnym języku obcym, dotyczących zagadnień szczegółowych w zakresie swojej specjalności, z wykorzystaniem podstawowych ujęć teoretycznych, a także różnych źródeł informacji.	Student posiada umiejętności pozwalające na analizę i wykorzystanie w swoich badaniach literatury w języku nowożytnym oraz potrafi przygotować własną pracę w tym języku.	[SU3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna

	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRMU2_U05] Prawidłowo posługuje się systemami normatywnymi oraz wybranymi normami i regulami (prawnymi, zawodowymi, moralnymi) w celu rozwiązania pogłębionych problemów z zakresu finansów i rachunkowości. Posiada umiejętność sprawnego wykorzystania systemu normatywnego właściwego dla swojej specjalności.	Student na bieżąco analizuje regulacje prawne obowiązujące na rynku finansowym. Potrafi określić jakie będą konsekwencje ich zmian w odniesieniu do portfela inwestycyjnego.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRMU2_W05] Ma rozszerzoną wiedzę o zaawansowanych metodach i narzędziach, w tym technikach pozyskiwania i analizy danych, właściwych dla nauk społecznych, pozwalających opisywać struktury i instytucje ekonomiczne oraz procesy w nich i między nimi zachodzące.	Student ma rozszerzoną wiedzę o zaawansowanych metodach i narzędziach ilościowej analizy danych, w tym o technikach pozyskiwania i przetwarzania danych, w zakresie zarządzania portfelem inwestycyjnym.	[SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SW3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna
	[FiRMU2_K01] Samodoskonalenie: - rozumie potrzebę rozwoju i uczenia się przez całe życie, - inspiruje innych do nauki, - potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę i umiejętności, rozszerzone o wymiar interdyscyplinarny, - zna swoje silne i słabe strony, stawia sobie ambitne cele na miarę swoich możliwości, - umie przyjąć porażkę, przyznać się do błędu.	Student rozumie potrzebę rozwoju i uczenia się przez całe życie, chce i potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę w zakresie zarządzania portfelem inwestycyjnym.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRMU2_W09] Zna i rozumie w pogłębionym stopniu struktury gramatyczne i słownictwo w zakresie swojej specjalności w języku obcym na poziomie B2+.	Student ma rozszerzoną wiedzę w zakresie gramatyki i słownictwa odnośnie zarządzania portfelem inwestycyjnym.	[SW2] prezentacja/projekt/referat/ raport
Treści przedmiotu	1. Proces zarządzania portfelem; oświadczenie o polityce inwestycyjnej: perspektywa portfela, zarządzanie portfelem jako proces, cele i ograniczenia inwestycyjne. 2. Zarządzanie portfelami inwestorów instytucjonalnych: fundusze emerytalne, branża ubezpieczeniowa, banki i inni inwestorzy instytucjonalni. 3. Oczekiwania rynku kapitałowego: oczekiwania rynku kapitałowego, analiza ekonomiczna. 4. Alokacja aktywów: cele inwestora dotyczące ryzyka i zwrotu, wybór klas aktywów, optymalizacja. 5. Monitorowanie i rebalancing: monitorowanie portfela, rebalancing portfela. 6. Ocena i składniki wyników portfela: pomiar, atrybucja, ocena.		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Statystyki opisowa i matematyczna; Instrumenty rynku finansowego		
Sposoby i kryteria oceniania osiąganych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	projekt realizowany na zajęciach i w domu	51.0%	40.0%
	pisemny test wyboru	51.0%	30.0%
	test pisemny z zadaniami do rozwiązania i pytaniami otwartymi	51.0%	30.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	1. Elton, E. J, Gruber, M. J., Brown, S. J, and W. N. Goetzmann, 2010, Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, John Wiley and Sons, 8th edition, 2010. 2. Maggin J.L., Tuttle D.L., McLeavey D.W., and Pinto J.E., Managing Investment Portfolio. A Dynamic Process, John Wiley & Sons, 2007.	
	Uzupełniająca lista lektur	1. Bacon C.R., Practical Portfolio Performance Measurement and Attribution, 2nd Edition, John Wiley & Sons, 2008	
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania			
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		