

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Zarządzanie portfelem inwestycyjnym , PG_00155622						
Kierunek studiów	Zarządzanie (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		
Semestr studiów	4		Liczba punktów ECTS		3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Rektor -> Wydział Zarządzania -> Katedra Inwestycji i Nieruchomości						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr Krzysztof Kowalke				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	15.0	15.0	0.0	0.0	0.0	30
	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	30		9.0		36.0	75
Cel przedmiotu	Zrozumienie podstawowych strategii związanych z zarządzaniem portfelem inwestycyjnym. Zapoznanie się z zasadami funkcjonowania rynków papierów wartościowych						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[ZARZMU2_W01] Ma rozszerzoną wiedzę w zakresie nauk społecznych ze szczególnym uwzględnieniem dyscypliny nauk o zarządzaniu i jakością oraz rozumie ich relację z innymi naukami społecznymi.	Ma podstawową wiedzę w zakresie rynków finansowych, zarządzania inwestycjami, czynnikami wpływającymi na wartość portfela inwestycyjnego oraz rozumie ich relację z różnymi dziedzinami nauki	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW1] wypowiedź ustna/rozmowa/dyskusja [SW2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[ZARZMU2_K01] Ma świadomość deprecjacji wiedzy w czasie i rozumie potrzebę uczenia się przez całe życie i pogłębiania wiedzy zarówno w trybie akademickim jak również pozaakademickim. Potrafi inspirować i organizować proces uczenia się innych osób.	Ma świadomość deprecjacji wiedzy o rynkach finansowych w czasie i rozumie potrzebę uczenia się przez całe życie i pogłębiania wiedzy zarówno w trybie akademickim jak również pozaakademickim	[SK2] prezentacja/projekt/referat/raport [SK4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[ZARZMU2_W14] Ma uporządkowaną, rozszerzoną wiedzę szczegółową z zakresu wybranej specjalności na kierunku zarządzanie.	Ma uporządkowaną podstawową wiedzę szczegółową z zakresu specjalności Inwestycje i Nieruchomości, zwłaszcza dotyczącą budowania portfela inwestycyjnego.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[ZARZMU2_U04] Potrafi w sposób kreatywny zastosować zdobytą wiedzę z zakresu nauk o zarządzaniu i jakości w praktyce zawodowej.	Potrafi zastosować zdobytą wiedzę z określonego obszaru nauk o zarządzaniu w praktyce zawodowej doradcy inwestycyjnego.	[SU1] wypowiedź ustna/rozmowa/dyskusja [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[ZARZMU2_K06] Jest gotów do pracy w grupach, współtworzenia ich bądź zarządzania nimi. Podejmuje inicjatywę podczas pracy w grupie. Potrafi kierować zespołem i sprawować nad nim nadzór.	Potrafi pracować w grupach, współtworzyć je bądź nimi zarządzać. Potrafi nadzorować proces budowania portfela inwestycyjnego przez zespół	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/dyskusja [SK2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[ZARZMU2_U05] Potrafi poprawnie wybrać oraz zastosować zaawansowane, złożone metody i narzędzia stosowane w naukach o zarządzaniu i jakości.	Potrafi poprawnie wybrać i zastosować metody i narzędzia stosowane w zarządzaniu inwestycjami finansowymi, zwłaszcza związane z analizą portfelową	[SU2] prezentacja/projekt/referat/raport [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
Treści przedmiotu	1.Podstawy budowy i zarządzania portfelem inwestycyjnym 2.Teoria portfelowa 3.Model jednowskaźnikowy Sharpea 4.Model rynku kapitałowego CAPM 5.Model rynku kapitałowego APT (model wyceny arbitrażowej) 6.Zarządzanie portfelem obligacji 7.Metody oceny efektywności portfela 8.Behawioralne aspekty budowy portfela inwestycyjnego 9.Inwestycje alternatywne, jako aktywa wzbogacające portfel inwestycyjny		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Znajomość podstaw matematyki finansowej, podstaw statystyki oraz podstaw zarządzania inwestycjami		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	test zaliczeniowy	51.0%	60.0%
	przygotowanie projektu	51.0%	40.0%

Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	Jajuga K., Jajuga T., 2006, Inwestycje: instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. PWN, Warszawa 2006 Ostrowska E, Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H.Beck, Warszawa 2014 Reilly F. K., Brown K. C. , 2001, Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, PWE, Warszawa
	Uzupełniająca lista lektur	Elton E. J., Gruber M. J. , 1998, Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, Wyd. WIG PRESS, Warszawa Tarczyński W., Rynki kapitałowe: Metody ilościowe Vol.2. Placet, Warszawa 1997 Dębski W., Rynek finansowy i jego mechanizmy. PWN, Warszawa 2010 Fabozzi F., Fong G. , 2000, Zarządzanie portfelem inwestycji finansowych przynoszących stały dochód, PWN, Warszawa
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania		
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy	

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.