

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Portfolio Analysis, PG_00157021						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2026/2027		
Poziom kształcenia	I stopnia - licencjackie		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	3		Język wykładowy		angielski angielski		
Semestr studiów	6		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	Zdobycie praktycznych umiejętności: statystycznej analizy rozkładu stóp zwrotu walorów i ich wzajemnych zależności, doboru walorów do portfela, oceny efektywności zarządzania portfelem inwestycyjnym z wykorzystaniem programów Excel i Gretl.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRL3_K03] Komunikacja: - potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie - odważnie (ale z rozwagą) wyraża swoje zdanie, nie boi się zadawać pytań - potrafi kulturalnie uczestniczyć w dyskusji - umie wyrażać konstruktywną krytykę.	Student działa jako członek zespołu lub lider zespołu, realizując zadania klasowe lub projekty kursowe, moderuje i uczestniczy w dyskusjach, wyraża własne opinie i konstruktywną krytykę projektów swoich kolegów.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/ dyskusja [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRL3_U04] Potrafi prognozować procesy i zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi.	Student potrafi: wybrać odpowiednią miarę statystyczną i uzasadnić wybór, skonstruować zestaw portfeli dla różnych wynagrodzeń, oszacować i zinterpretować model CAPM, obliczyć wskaźniki efektywności portfela.	[SU3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna [SU6] demonstracja umiejętności praktycznych
	[FiRL3_W02] Ma zaawansowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących, w szczególności o: systemie bankowym, ubezpieczeniowym, podatkowym, rynkach finansowych, organizacji systemu finansów publicznych oraz sektora prywatnego. Zna wzajemne relacje pomiędzy tymi strukturami i instytucjami społecznymi w skali krajowej i międzynarodowej.	Student potrafi: opisać środowisko inwestycyjne, porównywać portfele inwestorów indywidualnych i instytucjonalnych.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna
	[FiRL3_W06] Zna zaawansowane metody i narzędzia, w tym techniki pozyskiwania i analizy danych, właściwe dla nauki o zarządzaniu i jakości, pozwalające opisywać struktury i instytucje ekonomiczne oraz procesy w nich i między nimi zachodzące.	Student potrafi: obliczać i interpretować różne rodzaje stóp zwrotu, uzyskiwać i interpretować rozkład stóp zwrotu, konstruować portfel w ramach modelu ryzyko-zwrot oraz oceniać wyniki portfela.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW3] opracowanie tekstowe/ praca pisemna
	[FiRL3_U03] Potrafi właściwie analizować przyczyny, przebieg i skutki konkretnych procesów i zjawisk w zakresie finansów i rachunkowości, z wykorzystaniem zaawansowanych teorii i właściwych metod nauk społecznych. Potrafi zidentyfikować interesariuszy procesów i zjawisk z dyscyplin: nauki o zarządzaniu i jakości oraz ekonomia i finanse.	Student posiada pogłębioną umiejętność przygotowania analizy empirycznej z wykorzystaniem elementów teoretycznych i przedstawieniem wyników przeprowadzonej samodzielnie analizy portfelowej.	[SU5] realizacja zadania problemowego [SU6] demonstracja umiejętności praktycznych
	[FiRL3_K02] Współpraca: - potrafi harmonijnie współdziałać i pracować w grupie, przyjmując w niej różne role - 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 analizą portfela inwestycyjnego.	[SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
Treści przedmiotu	1. Podstawowe pojęcia analizy portfelowej w świetle teorii średniej wariancji stóp zwrotu. 2. Źródła danych dla analizy portfela papierów wartościowych. 3. Badanie własności stóp zwrotu walorów i ich wzajemnej struktury zależności. 4. Konstrukcja portfela walorów, średnia stopa zwrotu i ryzyko portfela. 5. Wybrane modele wyceny. Wskaźniki oceny efektywności zarządzania portfelem. 6. Rankingi portfeli wg wybranych wskaźników efektywności. 7. Badanie zgodności i powtarzalności rankingów.		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Elementy algebry liniowej; podstawy statystyki opisowej i matematycznej		
Sposoby i kryteria oceniania osiąganych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	projekt opracowany w laboratorium i w domu	51.0%	50.0%
	test pisemny wielokrotnego wyboru	51.0%	50.0%

Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	1. Elton E.J., Gruber M.J., Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, WIG Press, Warszawa 1998. 2. Haugen R.A., Teoria nowoczesnego inwestowania, WIG Press, Warszawa 1996. 3. Ostrowska E., Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H. Beck, Warszawa 2011. 4. Zamojska A., Ocena efektywności funduszy inwestycyjnych. Studium teoretyczno-empiryczne, C.H. Beck, Warszawa 2012.
	Uzupełniająca lista lektur	1. Brigham E.F., Gapenski L.C., Zarządzanie finansami t. I. PWE, Warszawa 2000. 2. Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje, instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN, Warszawa 2001.
	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.