

| | | | | |
|-------------------|---------------------------------------|--|---------|---------|
| Nazwa przedmiotu: | ELEMENTY ZARZĄDZANIA PORTFELEM | | | |
| Forma: Wykład | Godzin: 15 Semestr: 6 Rok: III | Forma zaliczenie: zal. na ocenę | ECTS 2 | |
| Wydział: ZIF | Kierunek: Finanse i Rachunkowość | Tryb: stacjonarny Rodzaj: licencjackie | | |
| Specjalność: RF | | | | |
| Tytuł, stopień | Imię i nazwisko lub nazwa katedry | e-mail | telefon | Pok/bud |
| dr | Katarzyna Kuziak | katarzyna.kuziak@ue.wroc.pl | 401 | 708 Z |

1. Wymagania wstępne

Podstawy statystyki, podstawy nauki o finansach, rynek kapitałowy i pieniężny.

2. Program przedmiotu

Efektywność rynku, podejścia w analizie akcji. Miary dochodu i ryzyka, rodzaje ryzyka inwestycyjnego. Podstawy teorii użyteczności i pomiaru awersji inwestora do ryzyka. Teoria portfela akcji dwóch spółek. Teoria portfela akcji wielu spółek. Instrumenty wolne od ryzyka w portfelu. Inne kryteria tworzenia portfela. Metoda stochastycznej dominacji. Dywersyfikacja międzynarodowa. Model jednowskaźnikowy Sharpe'a i modele wielowskaźnikowe. Model CAPM. Model APT. Zabezpieczanie portfela. Zarządzanie portfelem – proces, mierniki. Strategie zarządzania portfelem różnych inwestorów.

3. Metodyka zajęć

wprowadzenie pojęć i aparatu narzędziowego wraz z przykładami zastosowania.

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: poznanie metod pomiaru dochodu i ryzyka na rynku kapitałowym oraz zasad konstrukcji i zarządzania portfelem papierów wartościowych,

umiejętności: zastosowanie poznanych narzędzi w określeniu składu portfela papierów wartościowych, zarządzania nim oraz zabezpieczania.

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Jajuga K., Jajuga T.: Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. PWN, Warszawa 2006.
2. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P.: Inwestycje finansowe. Wyd. AE, Wrocław 1998.
3. Elton E.J., Gruber M.J.: Nowoczesna teoria portfelowo i analiza papierów wartościowych. WIG PRESS, Warszawa 1998.
4. Haugen R.A.: Teoria nowoczesnego inwestowania. Obszerny podręcznik z analizy portfelowo. WIG PRESS, Warszawa 1996.

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)