



Przedmiot: Portfel inwestycyjny				
Forma zajęć: ćwiczenia	Semestr: 4	Rok: 2	Wymiar godzin: 18	Punkty ECTS:
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski
Kierunek: Finanse i Rachunkowość			Tryb: niestacjonarne zaoczne	Rodzaj: magisterskie
Specjalność: wszystkie na kierunku				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Marek Pauka, dr Michał Muszyński		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Finanse przedsiębiorstw, matematyka, ekonometria, rynki finansowe

Program przedmiotu:

1. Metody analizy ryzyka i dochodowości: akcje, obligacje, obligacje zamienne, instrumenty pochodne
2. Metody wyceny papierów wartościowych
3. Ilościowe i jakościowe zasady dywersyfikacji portfela inwestycyjnego
5. Konstrukcja portfela akcji
6. Zarządzanie portfelem akcji
7. Konstrukcja portfela obligacji
8. Zarządzanie portfelem obligacji
9. Metody analizy efektywności portfela inwestycyjnego
10. Zabezpieczenie wartości portfela inwestycyjnego za pomocą instrumentów pochodnych

Metody dydaktyczne:

rozwiązywanie zadań, analizy przypadków

Cele przedmiotu:

umiejętność identyfikacji ryzyka w zależności od rodzaju instrumentu finansowego, analiza ryzyka inwestycyjnego, ograniczanie i dywersyfikacja ryzyka inwestycyjnego, konstruowanie portfeli inwestycyjnych przy wybranych kryteriach optymalizacji w zakresie dochodu i ryzyka

Warunki zaliczenia:

zaliczenie w formie otwartych zadań

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

- I. K. Jajuga, T. Jajuga, Inwestycje. Instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN 2000 lub nowsze
- II. E. J. Elton, M. J. Gruber, Nowoczesna teoria portfelowa i analiza papierów wartościowych, WIG PRESS 1998
- III. R. A. Haugen, Teoria nowoczesnego inwestowania, WIG PRESS 1996

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. F. K. Reilly, K.C. Brown, Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, T1 i T2, PWE 2001
2. F. Fabozzi, Rynki obligacji: analiza i strategię, WIG PRESS 2000
3. W. Tarczyński, Rynki kapitałowe, T1 i T2, PLACET 1997