



Przedmiot: Portfel inwestycyjny				
Forma zajęć: laboratorium	Semestr: 4	Rok: 2	Wymiar godzin: 9	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. Konstrukcja portfela akcji
3. Zarządzanie portfelem akcji
4. Konstrukcja portfela obligacji
5. Zarządzanie portfelem obligacji
6. Metody analizy efektywności portfela inwestycyjnego

Metody dydaktyczne:

analizy przypadków z wykorzystaniem MS Excel

Cele przedmiotu:

konstruowanie portfeli inwestycyjnych przy wybranych kryteriach optymalizacji w zakresie dochodu i ryzyka

Warunki zaliczenia:

zaliczenie w formie projektu

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 portfelową 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