



<b>Przedmiot:</b> Portfel inwestycyjny				
<b>Forma zajęć:</b> wykład	<b>Semestr:</b> 4	<b>Rok:</b> 2	<b>Wymiar godzin:</b> 18	<b>Punkty ECTS:</b> 7
<b>Forma zaliczenia:</b> egzamin	<b>Typ przedmiotu:</b> obowiązkowy		<b>Język nauczania:</b> polski	
<b>Kierunek:</b> Finanse i Rachunkowość		<b>Tryb:</b> niestacjonarne zaoczne		<b>Rodzaj:</b> magisterskie
<b>Specjalność:</b> wszystkie na kierunku				
<b>Katedra:</b> Katedra Finansów				
<b>Stopień naukowy wykładowcy:</b> dr		<b>Imię i nazwisko wykładowcy:</b> Marek Pauka , Michał Muszyński		

**Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):**

Finanse przedsiębiorstw, matematyka, ekonometria, rynki finansowe

**Program przedmiotu:**

1. Rodzaje inwestycji finansowych
2. Metody analizy ryzyka i dochodowości: akcje, obligacje, obligacje zamienne, instrumenty pochodne
3. Metody wyceny papierów wartościowych
4. 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:**

wykład z wykorzystaniem narzędzi multimedialnych

**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:**

Egzamin w formie testu

**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