



Przedmiot: Zarządzanie portfelem papierów wartościowych				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 8	Rok: 4	Wymiar godzin: 15	Punkty ECTS:
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski
Kierunek: Finanse i Bankowość			Tryb: stacjonarne	Rodzaj: jednolite magisterskie
Specjalność: IiN				
Katedra: Katedra Finansów				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Michał Muszyński		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Rynek kapitałowy

Program przedmiotu:

1. Pojęcie instrumentu finansowego oraz ryzyka finansowego
2. Miary ryzyka
3. Podstawy teorii portfela
 - wyznaczanie portfeli efektywnych (portfel dwu i wieloskładnikowy)
 - proces tworzenia portfela
 - skłonność do ryzyka
4. Wycena papierów wartościowych
 - Model CAPM
 - Model APT
 - Model dwumianowy wyceny opcji
 - Model Blacka – Scholesa
5. Teoria efektywności rynku

Metody dydaktyczne:

Metoda podająca , wykład informacyjny, z wykorzystaniem techniki audiowizualnej (slajdy -projektor multimedialny), dyskusja .

Cele przedmiotu:

Kurs pozwala na zapoznanie studentów z metodami tworzenia portfeli inwestycyjnych i z założeniami teorii portfela.

Warunki zaliczenia:

Kolokwium

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

Elton Grubber „Nowoczesna teoria portfela i analiza papierów wartościowych”

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):