



## KARTA OPISU PRZEDMIOTU

**Przedmiot:** **MODELE INWESTYCYJNE**  
**INVESTMENT MODELS**

**Poziom kształcenia i forma studiów:** Studia drugiego stopnia stacjonarne i niestacjonarne

**Rok rozpoczęcia cyklu kształcenia:** 2022/2023

**Liczba punktów ECTS:** 4,0

**Forma zaliczenia przedmiotu:** E

**Język wykładowy:** polski

**Kierunek / Dyscyplina:** Finanse i rachunkowość

**Wydział:** Kolegium Studiów

**Wykładowca:**

dr RAFAŁ BUŁA  
dr hab., prof. UE MONIKA FOLTYN-ZARYCHTA  
dr hab., prof. UE KRYSZTIAN PERA

**Prowadzący ćwiczenia:**

dr RAFAŁ BUŁA  
dr hab., prof. UE MONIKA FOLTYN-ZARYCHTA  
dr inż. BARTŁOMIEJ JABŁOŃSKI  
dr DOROTA KIKA  
dr hab., prof. UE KRYSZTIAN PERA

**Egzaminator:**

dr RAFAŁ BUŁA  
dr hab., prof. UE MONIKA FOLTYN-ZARYCHTA  
dr inż. BARTŁOMIEJ JABŁOŃSKI  
dr DOROTA KIKA  
dr hab., prof. UE KRYSZTIAN PERA

**Prowadzący laboratorium:**

**Katedra prowadzącego przedmiot:** Katedra Inwestycji

**Kurator kierunku / dyscypliny:** dr hab. Joanna Błach, prof. UE

**Liczba godzin kontaktu ze studentem / doktorantem:**

Forma zajęć	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
wykład	15	-
ćwiczenia	15	18
laboratoria	-	-
lektoraty	-	-
seminarium	-	-
proseminarium	-	-
razem	30	18
egzamin (godz.)	3	3

**Czas trwania w semestrach:** 1

**Min. semestr rozpoczęcia:** 3

**Maks. semestr rozpoczęcia:** 3

**Status przedmiotu:** Przedmiot obowiązkowy

**Wymagania:**

Obowiązkowe: DECYZJE INWESTYCYJNE  
Zalecane: STATYSTYKA I EKONOMETRIA W FINANSACH I RACHUNKOWOŚCI

**Maks.liczba studentów/doktorantów:**

wykład:                      ćwiczenia:

**Cele przedmiotu:**

Celem przedmiotu jest poszerzenie wiedzy studentów z zakresu inwestycji w papiery wartościowe obciążone ryzykiem. Na bazie umiejętności nabytych na studiach I stopnia przedstawione zostaje modelowe ujęcie zagadnień inwestycji finansowych. Chodzi o rozumienie oraz umiejętność konstrukcji efektywnego portfela aktywów finansowych. Ponadto w przedmiocie obok

warstwy merytorycznej zawarty jest element metodyczny, który ma na celu wyjaśnienie jaka jest metodyka konstrukcji modeli ekonomicznych i praktycznego ich zastosowania.

**Słowa kluczowe:** model ekonomiczny, model rynku kapitałowego, portfel efektywny, równowaga efektywnościowa, ryzyko inwestycyjne, stopa zwrotu

**Efekty uczenia się dla przedmiotu, ich odniesienie do efektów przyjętych na kierunku / dla dyscypliny oraz sposoby weryfikacji osiągnięcia:**

Symbole efektów uczenia się dla kierunku / specjalności / dyscypliny	Efekty uczenia się dla przedmiotu	Metody weryfikacji osiągnięcia efektów uczenia się dla przedmiotu	Dokumentacja
<b>Wiedza</b>			
FiR2_W01#	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu zjawiska oraz procesy zachodzące na współczesnym rynku kapitałowym, jak również teorie pozwalające wyjaśniać złożone zależności między nimi.	Egzamin pisemny, kolokwium pisemne	Prace egzaminacyjne i kolokwialne
<b>Umiejętności</b>			
FiR2_U01#	Potrafi wykorzystać nabytą, pogłębioną wiedzę do identyfikacji, krytycznej analizy i syntezy zjawisk oraz procesów zachodzących w sferze inwestycji w papiery wartościowe. Potrafi rozwiązywać złożone problemy pojawiające się na rynku kapitałowym przez wykorzystanie właściwych metod i narzędzi ilościowych.	Kolokwium pisemne	Prace kolokwialne
<b>Kompetencje społeczne</b>			
FiR2_K01#	Jest gotów do krytycznej oceny własnej wiedzy oraz odbieranych treści w obszarze inwestowania w papiery wartościowe.	Kolokwium pisemne	Prace kolokwialne

**Sposób ustalenia oceny z przedmiotu:**

Lp.	Forma i warunki zaliczenia przedmiotu	Opis	Udział w ocenie z przedmiotu (w %)
1	Egzamin pisemny bez możliwości korzystania z podręczników	Kompleksowy sprawdzian pisemny weryfikujący opanowanie treści zajęć oraz wykazujący stopień opanowania przedmiotu poprzez pracę własną (wykład).	50,00%
2	Kolokwium pisemne	Kontrolna praca pisemna w formie rozwiązywania zadań (ćwiczenia).	50,00%