



## KARTA OPISU PRZEDMIOTU

**Przedmiot:** PORTFOLIO MANAGEMENT WITH EXCEL AND VBA

**Poziom kształcenia i forma studiów:** Studia pierwszego stopnia licencjackie stacjonarne **Rok rozpoczęcia cyklu kształcenia:** 2020/2021

**Liczba punktów ECTS:** 3,0 **Forma zaliczenia przedmiotu:** Z **Język wykładowy:** angielski

**Kierunek / Dyscyplina:** Finance and Accounting **Wydział:** Szkoła Studiów I i II Stopnia

**Wykładowca:** dr RAFAŁ BUŁA **Prowadzący ćwiczenia:**

**Egzaminator:** dr RAFAŁ BUŁA **Prowadzący laboratorium:**

**Katedra prowadzącego przedmiot:** Katedra Inwestycji

**Kurator kierunku / dyscypliny:** dr hab. Monika Klimontowicz, prof. UE, Katedra Bankowości i Rynków Finansowych

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

Forma zajęć	Studia stacjonarne	Studia niestacjonarne
wykład	15	-
ćwiczenia	-	-
laboratoria	-	-
lektoraty	-	-
seminarium	-	-
proseminarium	-	-
razem	15	0
egzamin (godz.)	-	-

**Czas trwania w semestrach:** 1 **Min. semestr rozpoczęcia:** **Maks. semestr rozpoczęcia:**

**Status przedmiotu:** Przedmiot do wyboru

**Wymagania:** **Maks.liczba studentów/doktorantów:**  
 Obowiązkowe: CAPITAL BUDGETING & INVESTMENT ANALYSIS  
 METHODS OF FINANCIAL MARKET ANALYSIS  
 wykład:                      ćwiczenia:

Zalecane:

### Cele przedmiotu:

- Przekazanie wiedzy dotyczącej możliwości wykorzystania środowiska MS Excel w zarządzaniu portfelem instrumentów finansowych.
- Nabycie przez studentów umiejętności budowy algorytmów pozwalających ocenić ryzyko instrumentów finansowych oraz optymalizować strukturę portfeli ze względu na wybrane miary ryzyka.

**Słowa kluczowe:** MS Excel, teoria portfela, zarządzanie portfelem

**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>			
FiR1_W02#	Zna narzędzia Excela oraz struktury języka VBA pozwalające analizować instrumenty finansowe, budować efektywne portfele oraz zarządzać nimi.	Zaliczenie przy stanowisku komputerowym	Zapis elektroniczny prac zaliczeniowych studentów
<b>Umiejętności</b>			
FiR1_U01#	Potrafi zastosować poznane narzędzia Excela i struktury języka VBA do rozwiązywania problemów z zakresu zarządzania portfelem.	Zaliczenie przy stanowisku komputerowym	Zapis elektroniczny prac zaliczeniowych studentów
<b>Kompetencje społeczne</b>			
FiR1_K04#	Potrafi przewidywać skutki finansowe konstrukcji określonych portfeli inwestycyjnych	Zaliczenie przy stanowisku komputerowym	Zapis elektroniczny prac zaliczeniowych studentów

**Sposób ustalenia oceny z przedmiotu:**

Lp.	Forma i warunki zaliczenia przedmiotu	Opis	Udział w ocenie z przedmiotu (w %)
1	Praca przy komputerze bez możliwości korzystania z podręczników	Pytania i zadania do rozwiązania z zakresu budowy i modelowania portfela instrumentów finansowych (wykład).	100,00%