

Ryzyko w portfelu inwestycyjnym

Poziom: Średniozaawansowany

Opis: Na tym streamie dowiesz się w jaki sposób efektywnie balansować między ryzykiem a zyskiem w portfelu inwestycyjnym. Poruszymy tematy z zakresu zarządzania ryzykiem, miar ryzyka, optymalizacji portfela, podstaw psychologii behawioralnej czy hedgingu. Stream jest ukierunkowany na łączenie teorii z praktyką dlatego przeanalizujemy wspólnie wiele case study. Otrzymasz ode mnie narzędzia oraz wiedzę, które będziesz mógł wykorzystać zarówno w życiu prywatnym jak i zawodowym.

Wymagania wstępne:

- Podstawowa znajomość statystyki
- Znajomość Excel
- Znajomość instrumentów finansowych
- Podstawowa znajomość pythona

Wymagania techniczne:

- Excel
- Edytor kodu np. Visual Studio Code, Jupyter Notebook wraz z aktywnym środowiskiem.
- Google Meet (dostęp do internetu, konto gmail)

Kryteria zdawalności:

- Test jednokrotnego wyboru (Zdawalność powyżej 70%)

Przegląd kursu:

1. Dane finansowe i proces zarządzania ryzykiem
2. Rodzaje ryzyka, relacja ryzyko-zysk, znane porażki wynikające ze złego zarządzania ryzykiem i lekcje, które możemy z nich wyciągnąć.
3. Modelowanie zmienności i korelacja w portfelu.
4. Value At Risk, Expected Shortfall i dystrybucje
5. Nowoczesna Teoria Portfela i Model CAPM
6. Hedging portfela oraz instrumenty pochodne
7. Błędy poznawcze i heurystyki w portfelu

Harmonogram:

07.03.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
14.03.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
21.03.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
28.03.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
04.04.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
11.04.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15

25.04.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
09.05.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
16.05.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
22.05.2025 (Czwartek) 17:45 - 19:15
23.05.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15
30.05.2025 (Piątek) 17:45 - 19:15 (Egzamin końcowy)