



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Investment strategies, PG_00045379										
Kierunek studiów	Inżynieria danych										
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu		2027/2028							
Poziom kształcenia	I stopnia - inżynierskie	Grupa zajęć		Grupa zajęć fakultatywnych Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademycki							
Forma studiów	stacjonarne	Sposób realizacji		na uczelni							
Rok studiów	4	Język wykładowy		angielski							
Semestr studiów	7	Liczba punktów ECTS		4.0							
Profil kształcenia	ogółnoakademicki	Forma zaliczenia		zaliczenie							
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Finansów										
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot	dr inż. Marcin Potrykus									
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu	dr inż. Marcin Potrykus									
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM				
	Liczba godzin zajęć	0.0	0.0	30.0	0.0	0.0	30				
W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0											
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów		Udział w konsultacjach	Praca własna studenta		RAZEM				
	Liczba godzin pracy studenta	30		2.0	68.0		100				
Cel przedmiotu	Nabycie wiedzy i umiejętności w konstruowaniu strategii inwestycyjnych przy zastosowaniu wybranych narzędzi.										
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu						
	[K6_W03] identyfikuje wiarygodne źródła informacji istotne dla analizowanych zagadnień		Poznaje rzetelne źródła danych zawierające historyczne ceny transakcyjne. Identyfikuje ich przydatność do poznanych metod badawczych.		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej						
	[K6_K03] wykazuje się zdolnością do krytycznego i analitycznego myślenia oraz integruje wiedzę z wielu dyscyplin w celu podejmowania efektywnych decyzji		Stosuje różnorodne kryteria konstrukcji portfela inwestycyjnego (strategie: minimalizacji ryzyka inwestycyjnego, maksymalizacja efektywności czy maksymalizacja stopy zwrotu). Łączy wiedzę z finansów korporacyjnych z wyborem odpowiedniej strategii inwestycyjnej.		[SK2] Ocena postępów pracy						
	[K6_U06] zdobywa nową wiedzę, planując własny rozwój sprzyjający osiąganiu wyznaczonych celów		Konstruuje optymalny portfel inwestycyjny wg teorii Markowitza. Ocenia efektywność inwestycji na podstawie współczynnika Beta i Alfę Jensaena. Konstruuje strategię w oparciu o analizę zdarzeń.		[SU1] Ocena realizacji zadania						

Treści przedmiotu	<p>Podstawowy i złożony obszar analizy inwestycyjnej.</p> <p>Ryzyko i zwrot z inwestycji - metody pomiaru;</p> <p>Teoria budowy portfela inwestycyjnego;</p> <p>Pomiar efektywności inwestycji;</p> <p>Analiza zdarzeń i jej zastosowanie w konstruowaniu strategii inwestycyjnej;</p> <p>Instrumenty pochodne w kształtowaniu strategii inwestycyjnej.</p>								
Wymagania wstępne i dodatkowe	Zarządzanie finansami								
Sposoby i kryteria oceniania osiąganych efektów uczenia się	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Sposób oceniania (składowe)</th><th>Próg zaliczeniowy</th><th>Składowa oceny końcowej</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Kolokwia w czasie semestru</td><td>60.0%</td><td>100.0%</td></tr> </tbody> </table>			Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej	Kolokwia w czasie semestru	60.0%	100.0%
Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej							
Kolokwia w czasie semestru	60.0%	100.0%							
Zalecana lista lektur	<p>Podstawowa lista lektur</p> <p>Elton E.J., M.J. Gruber, S.J Brown, W.N. Goetzmann, Modern portfolio theory and investment analysis, Wiley 2017.</p> <p>Damodaran A., Investment Philosophies: Successful Strategies and the Investors Who Made Them Work, 2nd Edition, Wiley 2012.</p>	<p>Scott B. Smart, Lawrence J. Gitman, Michael D. Joehnk, Fundamentals of Investing, Essex 2016.</p>							
	<p>Uzupełniająca lista lektur</p> <p>Kufel T., Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu GRETL, PWN, Warszawa 2013.</p> <p>Lusznieiewicz A., Ślaby T., Statystyka z pakietem komputerowym STATISTICA PL, C.H.Beck, Warszawa 2008.</p> <p>Sharpe W. 1992. Asset allocation: management style and performance measurement. Journal of Portfolio Management 18, 719 (Article).</p> <p>Agarwal V., N. Y. Naik. 2004. Risks and portfolio decisions involving hedge funds. Review of Financial Studies 17, 63-98 (Article).</p>	<p>Miner R., High Probability Trading Strategies: Entry to Exit Tactics for the Forex, Futures, and Stock Markets, Wiley 2008.</p>							
	Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:							
Przykładowe zagadnienia/przykładowe pytania/realizowane zadania	<p>Konstrukcja optymalnego portfela inwestycyjnego.</p> <p>Wybór strategii inwestycyjnej w oparciu o zadane kryteria.</p>								
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy								

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.