

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 ogólnoakademicki		
Forma studiów	stacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	4		Język wykładowy		angielski		
Semestr studiów	7		Liczba punktów ECTS		4.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		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 osiągnięciu wyznaczonych celów		Konstruuje optymalny portfel inwestycyjny wg teorii Markowitza. Ocenia efektywność inwestycji na podstawie współczynnika Beta i Alfya Jensena. Konstruuje strategię w oparciu o analizę zdarzeń.		[SU1] Ocena realizacji zadania		

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

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.