



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Investment strategies, PG_00045379						
Kierunek studiów	Inżynieria danych						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2021 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2024/2025		
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_W11] ma wiedzę dotyczącą roli człowieka w strukturach społecznych oraz wpływu podejmowanych przez niego decyzji na sytuację ekonomiczną podmiotów gospodarczych	Poznaje metody opisujące ryzyko i zwrot z inwestycji. Opisuje mechanizm krótkiej sprzedaży.		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej			
	[K6_U12] posiada podstawowe umiejętności zastosowania narzędzi analitycznych w interpretowaniu procesów finansowych.	Konstruuje optymalny portfel inwestycyjny wg teorii Markowitza. Ocenia efektywność inwestycji na podstawie współczynnika Beta i Alfy Jensena. 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 osiągniętych efektów uczenia się	<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="448 703 794 736">Sposób oceniania (składowe)</th> <th data-bbox="794 703 1141 736">Próg zaliczeniowy</th> <th data-bbox="1141 703 1487 736">Składowa oceny końcowej</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="448 736 794 770">Kolokwia w czasie semestru</td> <td data-bbox="794 736 1141 770">60.0%</td> <td data-bbox="1141 736 1487 770">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	<table border="1"> <tr> <td data-bbox="448 799 794 1106">Podstawowa lista lektur</td> <td colspan="2" data-bbox="794 799 1487 1106"> <p>Scott B. Smart, Lawrence J. Gitman, Michael D. Joehnk, Fundamentals of Investing, Essex 2014.</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> </td> </tr> <tr> <td data-bbox="448 1113 794 1630">Uzupełniająca lista lektur</td> <td colspan="2" data-bbox="794 1113 1487 1630"> <p>Miner R., High Probability Trading Strategies: Entry to Exit Tactics for the Forex, Futures, and Stock Markets, Wiley 2008.</p> <p>Kufel T., Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu GRETL, PWN, Warszawa 2013.</p> <p>Luszniewicz A., Słaby 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> </td> </tr> <tr> <td data-bbox="448 1637 794 1671">Adresy eZasobów</td> <td colspan="2" data-bbox="794 1637 1487 1671">Adresy na platformie eNauczanie:</td> </tr> </table>			Podstawowa lista lektur	<p>Scott B. Smart, Lawrence J. Gitman, Michael D. Joehnk, Fundamentals of Investing, Essex 2014.</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>		Uzupełniająca lista lektur	<p>Miner R., High Probability Trading Strategies: Entry to Exit Tactics for the Forex, Futures, and Stock Markets, Wiley 2008.</p> <p>Kufel T., Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu GRETL, PWN, Warszawa 2013.</p> <p>Luszniewicz A., Słaby 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>		Adresy eZasobów	Adresy na platformie eNauczanie:	
Podstawowa lista lektur	<p>Scott B. Smart, Lawrence J. Gitman, Michael D. Joehnk, Fundamentals of Investing, Essex 2014.</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>											
Uzupełniająca lista lektur	<p>Miner R., High Probability Trading Strategies: Entry to Exit Tactics for the Forex, Futures, and Stock Markets, Wiley 2008.</p> <p>Kufel T., Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu GRETL, PWN, Warszawa 2013.</p> <p>Luszniewicz A., Słaby 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>											
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											