



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Investment strategies, PG_00045379							
Kierunek studiów	Inżynieria danych							
Data rozpoczęcia studiów	październik 2022 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2025/2026			
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	Nabywanie 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_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		
[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			
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	<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		
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		