POLITECHNIKA GDAŃSKA

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Investment strategies, PG_00067412		
Kierunek studiów	Inżynieria danych, Inżynieria danych		
Data rozpoczęcia studiów	październik 2026 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu	2029/2030
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	3.0
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia	zaliczenie
Jednostka prowadząca	Wydziały Politechniki Gdańskiej -> 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

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	3.0	42.0	75

Cel przedmiotu

Nabycie wiedzy i umiejętności w konstruowaniu strategii inwestycyjnych przy zastoswaniu wybranych narzędzi.

Efekty uczenia się przedmiotu

Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
[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 Alfy Jensena. Konstruuje strategię w oparciu o analizę zdarzeń.	[SU1] Ocena realizacji zadania
[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

<table>
<tr><td>Treści przedmiotu</td><td>Treści przedmiotu - laboratoria
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.</td></tr>
<tr><td>Wymagania wstępne i dodatkowe</td><td>Zarządzanie finansami</td></tr>
<tr><td>Sposoby i kryteria oceniania osiąganych efektów uczenia się</td><td>
<table>
<tr><th>Sposób oceniania (składowe)</th><th>Próg zaliczeniowy</th><th>Składowa oceny końcowej</th></tr>
<tr><td>Kolokwia w czasie semestru</td><td>60.0%</td><td>100.0%</td></tr>
</table>
</td></tr>
<tr><td>Zalecana lista lektur</td><td>
<table>
<tr><td>Podstawowa lista lektur</td><td>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.</td></tr>
<tr><td>Uzupełniająca lista lektur</td><td>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).</td></tr>
<tr><td>Adresy eZasobów</td><td></td></tr>
</table>
</td></tr>
<tr><td>Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania</td><td>Konstrukcja optymalnego portfela inwestycyjnego.

Wybór strategii inwestycyjnej w oparciu o zadane kryteria.</td></tr>
<tr><td>Zajęcia praktyczne w ramach przedmiotu</td><td>Nie dotyczy</td></tr>
</table>

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.