

Opis zajęć (syllabus): ...

Nazwa zajęć:	Strategie Inwestycyjne	ECTS	3
Nazwa zajęć w j. angielskim:	Investment Strategies		
Zajęcia dla kierunku studiów:	Finanse i Rachunkowość		

Język wykładowy: polski	Poziom studiów: 2		
Forma studiów: stacjonarne i niestacjonarne	Status zajęć: do wyboru	Numer semestru: semestr letni/zimowy	
Rok akademicki, od którego obowiązuje opis (rocznik):		2021/2022	Numer katalogowy:

Koordynator zajęć:	Dr Andrzej Karpio		
Prowadzący zajęcia:	Dr Andrzej Karpio		
Jednostka realizująca:	Instytut Ekonomii i Finansów, Katedra Ekonometrii i Statystyki		
Jednostka zlecająca:	Wydział Ekonomiczny		
Założenia, cele i opis zajęć:	<p>Zakładaniem celem przedmiotu jest zapoznanie studentów z teorią i praktyką dotyczącą strategii inwestycyjnych wykorzystywanych na rynku finansowym, do realizowania celów spekulacyjnych, hedgingowych oraz zarządzania ryzykiem. Student zapozna się strategiami wykorzystującymi m.in. obligacje i instrumenty pochodne. Oprócz teorii słuchacz zapozna się z praktyką stosowaną przez inwestorów instytucjonalnych: fundusze inwestycyjne, firmy ubezpieczeniowe, banki.</p> <p style="text-align: center;">Opis zajęć</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Idea budowy portfeli akcji w oparciu o model Markowitza; 2. Strategie wykorzystujące modele: wyceny aktywów kapitałowych (CAPM) i arbitrażu cenowego (APT); 3. Zastosowanie teorii portfelowej do budowania strategii wykorzystujących papiery dłużne, immunizacja; 4. Strategie zarządzania ryzykiem w banku lub firmie inwestycyjnej – VaR (wartość narażona na ryzyko); 5. Wybrane strategie zabezpieczające wykorzystujące kontrakty futures i opcje, współczynniki zabezpieczenia; 6. Strategie wykorzystujące statystyczne własności instrumentów udziałowych – arbitraż statystyczny; 7. Przykłady praktycznego zastosowania strategii zarządzania ryzykiem na przykładzie banku JP Morgan. 		
Formy dydaktyczne, liczba godzin:	a. wykład - liczba godzin: 15 b. ćwiczenia laboratoryjne - liczba godzin: 15		
Metody dydaktyczne:	rozwiązywanie problemu, konsultacje, studium przypadku		
Wymagania formalne i założenia wstępne:	Nie dotyczy.		
Efekty uczenia się:	Wiedza - Znaczenie i rozumie: P7U_W: w pogłębiony sposób wybrane fakty, teorie, metody oraz złożone zależności między nimi, także w powiązaniu z innymi dziedzinami różnorodnymi, złożone uwarunkowania i aksjologiczny kontekst prowadzonej działalności P7S_WG: w pogłębionym stopniu - wybrane fakty, obiekty i zjawiska oraz dotyczące ich metody i teorie wyjaśniające złożone zależności między nimi, stanowiące zaawansowaną wiedzę ogólną z zakresu dyscyplin naukowych lub artystycznych tworzących podstawy teoretyczne, uporządkowaną i podbudowaną teoretycznie wiedzę obejmującą kluczowe zagadnienia oraz wybrane zagadnienia z zakresu zaawansowanej wiedzy szczegółowej - właściwe dla programu studiów, główne tendencje rozwojowe dyscyplin naukowych lub artystycznych, do których jest przyporządkowany kierunek studiów - w przypadku studiów o profilu ogólnoakademickim	Umiejętności - Potrafi: P7U_U: wykonywać zadania oraz formułować i rozwiązywać problemy, z wykorzystaniem nowej wiedzy, także z innych dziedzin samodzielnie planować własne uczenie się przez całe życie i ukierunkowywać innych w tym zakresie komunikować się ze zróżnicowanymi kręgami odbiorców, odpowiednio uzasadniać stanowiska P7S_UW: wykorzystywać posiadaną wiedzę - formułować i rozwiązywać złożone i nietypowe problemy oraz innowacyjnie wykonywać zadania w nieprzewidywalnych warunkach przez: — właściwy dobór źródeł i informacji z nich pochodzących, dokonywanie oceny, krytycznej analizy, syntezy, twórczej interpretacji i prezentacji tych informacji, — dobór oraz stosowanie właściwych metod i narzędzi, w tym zaawansowanych technik informacyjno-komunikacyjnych, — przystosowanie istniejących lub opracowanie nowych metod i narzędzi formułować i testować hipotezy związane z prostymi problemami badawczymi - w przypadku studiów o profilu ogólnoakademickim	Kompetencje - Jest gotów do: P7U_K: tworzenia i rozwijania wzorów właściwego postępowania w środowisku pracy i życia odejmowania inicjatyw, krytycznej oceny siebie oraz zespołów i organizacji, w których uczestniczy przewodzenia grupie i ponoszenia odpowiedzialności za nią P7S_KK: krytycznej oceny posiadanej wiedzy i odbieranych treści uznawania znaczenia wiedzy w rozwiązywaniu problemów poznawczych i praktycznych oraz zasięgania opinii ekspertów w przypadku trudności z samodzielnym rozwiązaniem problemu

Sposób weryfikacji efektów uczenia się:	Zaliczenie na podstawie kolokwium podczas którego studenci będą rozwiązywali zadania rachunkowe	
Forma dokumentacji osiągniętych efektów uczenia się:	Prace pisemne studentów	
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową:	Rozwiązywanie zagadnień zleczanych podczas zajęć 50% Kolokwium zaliczające 50%	
Miejsce realizacji zajęć:	Sala dydaktyczna – wykład Sala komputerowa - ćwiczenia	
Literatura podstawowa i uzupełniająca:		
1. Broszura z treścią wykładów i przykładowymi zadaniami zaliczeniowymi; 2. Fabozzi J., E.: <i>Rynki obligacji, analiza i strategie</i> ; WIG-PRESS, Warszawa 2000r. 3. J.C. Francis – <i>Inwestycje. Analiza i zarządzanie</i> , WIG PRESS 2000 4. J. Hull J.: <i>Kontrakty terminowe i opcje, wprowadzenie</i> , WIG-PRESS Warszawa 1997,		
Uwagi:		
Wskaźniki ilościowe charakteryzujące moduł/przedmiot:		
Szacunkowa sumaryczna liczba godzin pracy studenta (kontaktowych i pracy własnej) niezbędna dla osiągnięcia zakładanych dla zajęć efektów uczenia się - na tej podstawie należy wypełnić pole ECTS:		75
Łączna liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich lub innych osób prowadzących zajęcia:		3

Tabela zgodności kierunkowych efektów uczenia się z efektami przedmiotu:			
Kategoria efektu	Efekty uczenia się dla zajęć:	Odniesienie do efektów dla programu studiów dla kierunku	Oddziaływanie zajęć na efekt kierunkowy*)
Wiedza	FIR2_KW01 rozszerzone podstawy teoretyczne zjawisk zachodzących w gospodarce, z uwzględnieniem sektora rolno-spożywczego	Finanse i Rachunkowość	znaczący
	FIR2_KW02 w pogłębionym stopniu metody pozyskiwania i przetwarzania danych właściwe dla ekonomii i finansów	Finanse i Rachunkowość	znaczący
Umiejętności	FIR2_KU01 w pogłębionym stopniu wykorzystywać wiedzę podczas doboru źródeł danych, metod, narzędzi, analiz i obliczeń w zakresie zjawisk zachodzących w obszarze finansów i rachunkowości, a także do krytycznej oceny i interpretacji uzyskanych wyników	Finanse i Rachunkowość	znaczący
	FIR2_KU02 umiejętnie analizować przyczyny i skutki zjawisk zachodzących w gospodarce w zakresie finansów i rachunkowości	Finanse i Rachunkowość	znaczący
Kompetencje	FIR2_KK01 uznawania głębokiego znaczenia wiedzy w życiu zawodowym, krytycznej analizy posiadanych jej zasobów oraz poszukiwania jej źródeł wśród ekspertów	Finanse i Rachunkowość	znaczący
	FIR2_KK02 prowadzenia działalności zawodowej w sposób odpowiedzialny społecznie, przedsiębiorczy, etyczny i zgodny z interesem publicznym, a także rozwijania dorobku zawodowego i podtrzymywania etosu zawodu, a także myślenia w sposób przedsiębiorczy	Finanse i Rachunkowość	znaczący

*) 3 – zaawansowany i szczegółowy, 2 – znaczący, 1 – podstawowy