



Przedmiot: Analiza i zarządzanie portfelem				
Forma zajęć: ćwiczenia	Semestr: 5	Rok: 3	Wymiar godzin: 7	Punkty ECTS: 0
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: do wyboru		Język nauczania: polski
Kierunek: Ekonomia			Tryb: stacjonarne	Rodzaj: licencjackie
Specjalność: Analityk rynku				
Katedra: Katedra Ekonomii Matematycznej				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Radosław Kurach		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Mikroekonomia, Informatyka, Statystyka

Program przedmiotu:

1. Hipoteza efektywności informacyjnej rynku a dywersyfikacja jako metoda zarządzania ryzykiem
2. Teoria portfela dwóch spółek
3. Teoria portfela wielu spółek
4. Teoria portfela z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka, teoria użyteczności
5. Modele rynku kapitałowego
6. Podstawy zarządzania portfelem w różnych instytucjach finansowych, mierniki jakości zarządzania portfelem
7. Barrings i LTCM - studium przypadków

Metody dydaktyczne:

Rozwiązywanie list zadań służących utrwaleniu materiału prezentowanego w ramach wykładu.

Cele przedmiotu:

Celem przedmiotu jest zrozumienie idei dywersyfikacji, co pozwala na konstruowanie portfeli maksymalizujących szanse realizacji zamierzonych celów inwestycyjnych.

Warunki zaliczenia:

Wykonanie w ramach laboratoriów projektu polegającego na konstrukcji portfela inwestycyjnego z wykorzystaniem rzeczywistych danych rynkowych.

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. Jajuga K., Kuziak K., Markowski P. (1997), Inwestycje finansowe, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego.
2. Jajuga K., Jajuga T. (2006), Inwestycje – instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, Wydawnictwo Naukowe PWN.

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Jajuga K. (red nauk.) (2007), Zarządzanie ryzykiem, Wydawnictwo Naukowe PWN.