



| | | | | |
|---|----------------------------------|---|--------------------------------|-----------------------------|
| Przedmiot: Analiza i zarządzanie portfelem | | | | |
| Forma zajęć: wykład | Semestr: 5 | Rok: 3 | Wymiar godzin: 15 | Punkty ECTS: 3 |
| 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, 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:

Wykład informacyjny z wykorzystaniem projektora multimedialnego, studium przypadków. Dodatkowe materiały zamieszczone na platformie e-learningu.

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.