



<b>Przedmiot:</b> Analiza i zarządzanie portfelem				
<b>Forma zajęć:</b> laboratorium	<b>Semestr:</b> 5	<b>Rok:</b> 3	<b>Wymiar godzin:</b> 15	<b>Punkty ECTS:</b>
<b>Forma zaliczenia:</b> zaliczenie na ocenę		<b>Typ przedmiotu:</b> do wyboru		<b>Język nauczania:</b> polski
<b>Kierunek:</b> Ekonomia			<b>Tryb:</b> stacjonarne	<b>Rodzaj:</b> licencjackie
<b>Specjalność:</b> Analityk rynku				
<b>Katedra:</b> Katedra Ekonomii Matematycznej				
<b>Stopień naukowy wykładowcy:</b> dr		<b>Imię i nazwisko wykładowcy:</b> 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:**

Wykorzystanie arkusza kalkulacyjnego w procesie konstrukcji portfela aktywów charakteryzującego się zadanymi parametrami.

**Cele przedmiotu:**

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

**Warunki zaliczenia:**

Wykonanie w ramach laboratorium 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.