

Nazwa przedmiotu:	ANALIZA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH			
Forma: Ćwiczenia	Godzin: 30 Semestr: II Rok: 2	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 4	
Wydział: ZIF	Kierunek: Informatyka i Ekonometria	Tryb: stacjonarny	Rodzaj: II stopień	
Specjalność: Ekonometria menedżerska II				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Paweł Porcenałuk, Krzysztof Piontek	pawel.porcenałuk@ue.wroc.pl	3680-373	709Z

1. Wymagania wstępne

Zaliczone przedmioty: Statystyka, Makroekonomia, Mikroekonomia, Rynek kapitałowy i pieniężny.

2. Program przedmiotu

Analiza rynku polskiego. Podstawowe informacje i klasyfikacja papierów wartościowych. Zasady obrotu giełdowego. Elementy analizy portfelowej. Założenia analizy fundamentalnej. Wskaźniki charakteryzujące efektywność. Analiza makro, gałęzi i otoczenia. Analiza przyczynowa. Wskaźniki rynkowe. Wskaźniki charakteryzujące banki i ubezpieczycieli. Analiza taksonomiczna i dyskryminacyjna jako metoda budowy portfela akcji Model Gordona i jego zastosowanie do analizy polityki dywidend. Cykle gospodarcze i rynek akcji (teorie Dowa i Elliotta). Rodzaje akcjogramów i średnie ruchome. Wskaźniki i formacje analizy technicznej.

3. Metodyka zajęć

zobrazowanie zagadnień teoretycznych przykładami z rynku polskiego, dyskusja na temat przedstawianych przypadków

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: funkcjonowanie rynku, klasyfikacja instrumentów finansowych, elementy otoczenia prawnego, efektywność rynku, elementy analizy portfelowej, fundamentalnej i technicznej,
umiejętności: samodzielna i krytyczna analiza instrumentów finansowych notowanych na GPW, znajomość przebiegu sesji giełdowej i rodzajów zleceń, ocena spółki za pomocą wskaźników fundamentalnych, elementy wyceny spółek, przewidywanie kursów za pomocą analizy technicznej

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa, PWN, Warszawa 2008.

Tarczyński W., Rynki Kapitałowe. Metody Ilościowe, Analiza techniczna. Analiza fundamentalna. Placet, 1997

Leszczyński Z., Skowronek-Mielczarek, Analiza ekonomiczno-finansowa spółki, PWE, Warszawa 2004

Marek Panfil (red.), Andrzej Szablewski, Andrzej Cwynar (i in.). Metody wyceny spółki : perspektywa klienta i inwestora, Warszawa : Poltext, 2006.

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

Zadora H., Wycena przedsiębiorstw: w teorii i praktyce., Stowarzyszenie Księgowych, Warszawa, 2005.

Czekała M., Analiza techniczna i fundamentalna, AE Wrocław, 1997.