

Nazwa przedmiotu:	ANALIZA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH			
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: III Rok: 2	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 2	
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	Krzysztof Piontek	krzysztof.piontek@ue.wroc.pl	3680-401	708Z

1. Wymagania wstępne

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

2. Program przedmiotu

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 akcyjogramów i średnie ruchome. Wskaźniki i formacje analizy technicznej.

3. Metodyka zajęć

wprowadzenie pojęć i aparatu narzędziowego wraz z przykładami zastosowania.

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiadomości: funkcjonowanie rynku, klasyfikacja instrumentów finansowych, elementy otoczenia prawnego, efektywność rynku, elementy analizy portfelowej, fundamentalnej i technicznej,
umiejętności: cechy instrumentów finansowych notowanych na GPW, system WARSET, 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.

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