

Nazwa przedmiotu:	ANALIZA DANYCH FINANSOWYCH			
Forma: Laboratorium	Godzin: 12 Semestr: 6 Rok: III	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 1	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Rachunkowość	Tryb: stacjonarny	Rodzaj: licencjackie	
Specjalność: RiP, RiA, RF, ZF				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Daniel Papla	daniel.papla@ue.wroc.pl	3680373	709-Z

1. Wymagania wstępne

Analiza matematyczna, Matematyka, Statystyka ekonomiczna i opisowa, Matematyka finansowa, Ekonometria, Finanse przedsiębiorstwa, Analiza finansowa

2. Program przedmiotu

Analiza finansowych szeregów czasowych

- źródła danych rzeczywistych – notowania giełdowe, kursy walut itp.
- analiza rozkładów stóp zwrotu
- procesy ARMA
- analiza danych z wykorzystaniem procesów GARCH
- wskazanie na zmienność wariancji w czasie, wprowadzenie procesu ARCH i GARCH do analizy zmienności wariancji
- przykłady praktycznego wykorzystania procesów GARCH - np. prognozowanie zmienności na potrzeby wyceny opcji

Analiza danych finansowych przedsiębiorstw:

- źródła danych rzeczywistych – raporty finansowe przedsiębiorstw
- charakterystyka danych
- wstęp do analizy taksonomicznej z wykorzystaniem danych finansowych
- model dyskryminacyjny Altmana
- porządkowanie i rangowanie przedsiębiorstw

3. Metodyka zajęć

Zajęcia prowadzone są w formie laboratorium komputerowego, gdzie studenci na danych rzeczywistych i symulowanych uczą się praktycznych aspektów analizy danych finansowych

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Celem przedmiotu jest zapoznanie studentów z praktycznym wykorzystaniem zdobytej w trakcie studiów wiedzy w analizie rzeczywistych danych z rynków finansowych, przedsiębiorstw itp. W trakcie zajęć studenci poznają m.in. zastosowanie procesów ARMA do wygładzania szeregów czasowych, wykorzystanie procesów GARCH w analizie zmienności wariancji i wycenie instrumentów pochodnych, czy też zastosowanie modelu Altmana do prognozowania upadłości przedsiębiorstw.

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

- W. Charemza, D.F. Deadman, Nowa ekonometria, PWE, Warszawa 1997
 R.S. Tsay, Analysis of Financial Time Series, Wiley 2002
 L. Bednarski i in., Analiza ekonomiczna w przedsiębiorstwie, AE, Wrocław 2001
 L. Bednarski., Analiza finansowa w przedsiębiorstwie, PWE, Warszawa 2006

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

- A. Loren, Excel - praktyczne zastosowania w biznesie, Helion, Gliwice 2005