

| | | | | |
|--------------------------------------|-------------------------------------|--|---------|---------|
| Nazwa przedmiotu: | Analiza papierów wartościowych | | | |
| Forma: Ćwiczenia | Godzin: 15 Semestr: 10 Rok: V | Forma zaliczenie: zal. na ocenę | ECTS 0 | |
| Wydział: ZIF | Kierunek: Informatyka i Ekonometria | Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie | | |
| Specjalność: Ekonometria menedżerska | | | | |
| Tytuł, stopień | Imię i nazwisko lub nazwa katedry | e-mail | telefon | Pok/bud |
| dr | Paweł Porcelanuk | zi_ifzr@ue.wroc.pl | 3680731 | 105M |

1. Wymagania wstępne

– Statystyka, Makroekonomia, Mikroekonomia, Rynek kapitałowy i pieniężny.

2. Program przedmiotu

Podstawowe informacje i klasyfikacja papierów wartościowych. Zasady obrotu giełdowego. 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

Zadania do samodzielnego rozwiązania, projekty indywidualne i grupowe, case study.

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

wiedomości: klasyfikacja papierów wartościowych i wskaźniki je charakteryzujące;

umiejętności: ocena spółki za pomocą wskaźników fundamentalnych i ocena sytuacji za pomocą wskaźników analizy technicznej.

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Czekala M., Analiza techniczna i fundamentalna, AE Wrocław, 1997.
2. Jajuga K., Jajuga T., Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa., PWN, Warszawa 2006.
3. Sierpińska M., Jachna T., Ocena przedsiębiorstwa według standardów światowych. PWN, Warszawa 1993.
4. Tarczyński W., Rynki Kapitałowe. Metody Ilościowe, Analiza techniczna. Analiza fundamentalna. Placet, 1997.

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

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