

Nazwa przedmiotu:	Analiza papierów wartościowych			
Forma: Wykład	Godzin: 30 Semestr: 10 Rok: V	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 6	
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

Wiadomości: całościowa narzędzi analizy instrumentów finansowych.
Umiejętności: wycena i analiza konkretnych instrumentów finansowych.

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.