

Rok akademicki:	Grupa przedmiotów	Numer katalogowy:		INF405
Nazwa przedmiotu ¹⁾ :	Analiza techniczna i fundamentalna			ECTS ²⁾ 3
Tłumaczenie nazwy na jęz. angielski ³⁾ :	Technical and Fundamental Analysis			
Kierunek studiów ⁴⁾ :				
Koordynator przedmiotu ⁵⁾ :	Dr Andrzej Karpio			
Prowadzący zajęcia ⁶⁾ :	Dr Andrzej Karpio			
Jednostka realizująca ⁷⁾ :	Wydział Zastosowań Informatyki i Matematyki, Katedra Ekonometrii i Statystyki, Zakład Inżynierii Finansowej			
Wydział, dla którego przedmiot jest realizowany ⁸⁾ :	Wydział Nauk Ekonomicznych			
Status przedmiotu ⁹⁾ :	a) przedmiot	b) stopień	c) rok	d) forma studiów
	SW	2	2	stacjonarne / niestacjonarne
Cykl dydaktyczny ¹⁰⁾ :	a) semestr		b) Jęz. wykładowy ¹¹⁾	
	4		polski	
Założenia i cele przedmiotu ¹²⁾ :	<p>Celem przedmiotu jest:</p> <ul style="list-style-type: none"> - zapoznanie studenta z podstawami analizy fundamentalnej i metodami wyceny spółek giełdowych - nabycie umiejętności podejmowania decyzji inwestycyjnych w oparciu o wskaźniki fundamentalne spółek <p>zapoznanie studenta z założeniami i metodologią analizy technicznej</p> <ul style="list-style-type: none"> - Nabycie umiejętności praktycznego stosowania wybranych narzędzi analizy technicznej 			
Formy dydaktyczne, liczba godzin ¹³⁾ :	a) forma dydaktyczna		b) liczba godzin	
	a1) wykład		15	
	a2) ćwiczenia audytoryjne			
	a3) ćwiczenia laboratoryjne		15	
Metody dydaktyczne ¹⁴⁾ :	dyskusja	(wstawiamy "T" lub puste)	eksperyment	
	projekt badawczy		studium przypadku	T
	rozwiązywanie problemu	T	gry symulacyjne	
	analiza i interpretacja tekstów źródłowych		indywidualne projekty studenckie	T
	konsultacje		inne ...	
	inne...		inne ...	
	inne...		inne ...	
Pełny opis przedmiotu ¹⁵⁾ :	<p>A. wykłady</p> <p>Analiza fundamentalna: omówienie kategorii analizy fundamentalnej, wprowadzenie do metod wyceny spółek (model Williamsa - Gordona), wskaźniki kapitalowe (cena do zysku, cena do wartości księgowej, topa dywidendy itd.) i ich wykorzystanie w decyzjach inwestycyjnych. Analiza techniczna: omówienie założeń i metodologii, zapoznanie studenta z podstawowymi narzędziami - analiza formacji, średnie, wskaźniki, oscylatory.</p> <p>B. ćwiczenia</p> <p>Podczas ćwiczeń w laboratorium komputerowym studenci będą zapoznawać się z informacjami finansowymi i ich interpretacją (rekomendacje, wskaźniki fundamentalne) dostępnymi na stronach GPW i portalach finansowych (bankier, money, bossa itd.). Część zajęć będzie polegała na ćwiczeniach rachunkowych pozwalających zrozumieć ideę wyceny w modelu Williamsa - Gordona. W części zajęć dotyczących analizy technicznej studenci będą wykorzystywali programy do analizy wykresów dostępne na portalach internetowych.</p>			
Wymagania formalne (przedmioty wprowadzające) ¹⁶⁾ :	Nie ma wstępnych wymagań formalnych			
Założenia wstępne ¹⁷⁾ :	Elementarna znajomość Excela oraz umiejętność czytania sprawozdań finansowych spółek akcyjnych.			

Efekty kształcenia ¹⁸⁾ : (z kolejnymi numerami, 01, 02, 03 itd.)	01 - Znajomość podstaw analizy fundamentalnej		05 - Praktyczne wykorzystywanie programów komputerowych w analizie technicznej	
	02 - Praktyczna umiejętność interpretowania wskaźników kapitałowych spółek		06 -	
	03 - Znajomość podstawowych narzędzi analizy technicznej		07 -	
	04 - Umiejętność sporządzania i czytania wykresów kursów akcji, średnich i formacji.		08 -	
Sposób weryfikacji efektów kształcenia ¹⁹⁾ :	kolokwium na zajęciach ćwiczeniowych		ocena wykonanie zadania projektowego na zdefiniowany temat	
	praca pisemna przygotowywana w ramach pracy własnej studenta	02, 04, 05	ocena wynikająca z obserwacji w trakcie zajęć	
	ocena eksperymentów wykonywanych w trakcie zajęć		przygotowanie zespołowej analizy zdefiniowanego problemu	
	ocena wystąpień i prezentacji w trakcie zajęć		obserwacja w trakcie dyskusji zdefiniowanego problemu (aktywność)	
	egzamin pisemny		test komputerowy	
	egzamin ustny	01, 03	inne..	
	inne...		inne..	
Forma dokumentacji osiągniętych efektów kształcenia ²⁰⁾ :	okresowe prace pisemne		imiennie karty oceny studenta	
	złożone projekty	T	treść pytań egzaminacyjnych z oceną	T
	inne...		inne..	
	inne...		inne..	
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową ²¹⁾ :	Element oceny	Waga w %	Element oceny	Waga w %
	kolokwium na zajęciach ćwiczeniowych		ocena wykonania zadania projektowego na zdefiniowany temat	
	praca pisemna przygotowywana w ramach pracy własnej studenta	50%	ocena wynikająca z obserwacji w trakcie zajęć	
	ocena eksperymentów wykonywanych w trakcie zajęć		przygotowanie zespołowej analizy zdefiniowanego problemu	
	ocena wystąpień i prezentacji w trakcie zajęć		obserwacja w trakcie dyskusji zdefiniowanego problemu (aktywność)	
	egzamin pisemny		test	
	egzamin ustny	50%	inne..	
inne...		inne..		
Miejsce realizacji zajęć ²²⁾ :	Laboratorium komputerowe z dostępem do internetu			
Literatura podstawowa i uzupełniająca ²³⁾ :				
a) podstawowa				
1. Murphy J. J., 1999. Analiza techniczna rynków finansowych, WIG PRESS, Warszawa				
2. J.C. Ritchie, 1997. Analiza fundamentalna, WIG PRESS, Warszawa				
b) uzupełniająca				
3. F.K. Reilly, K.C. Brown, 2001. Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem T1 i T2, PWE, Warszawa				
4. J.C. Francis, 2000. Inwestycje. Aanaliza i zarządzanie, WIG PRESS, Warszawa				
5.				
6.				
7.				
8.				
UWAGI ²⁴⁾ :				