

Analiza fundamentalna - opis przedmiotu

Informacje ogólne	
Nazwa przedmiotu	Analiza fundamentalna
Kod przedmiotu	14.3-WZ-EkoP-AF
Wydział	Wydział Ekonomii i Zarządzania
Kierunek	Ekonomia
Profil	ogólnoakademicki
Rodzaj studiów	pierwszego stopnia z tyt. licencjata
Semestr rozpoczęcia	semestr zimowy 2021/2022

Informacje o przedmiocie	
Semestr	4
Liczba punktów ECTS do zdobycia	2
Typ przedmiotu	obieralny
Język nauczania	polski
Sylabus opracował	dr Zbigniew Binek

Formy zajęć					
Forma zajęć	Liczba godzin w semestrze (stacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (stacjonarne)	Liczba godzin w semestrze (niestacjonarne)	Liczba godzin w tygodniu (niestacjonarne)	Forma zaliczenia
Wykład	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę
Laboratorium	15	1	9	0,6	Zaliczenie na ocenę

Cel przedmiotu

Celem przedmiotu jest nabycie przez studentów wiedzy, kompetencji i umiejętności z zakresu elementów analizy fundamentalnej oraz zapoznanie z praktycznymi implikacjami wykorzystania analizy fundamentalnej w przedsiębiorstwach i w procesie inwestycyjnym.

Wymagania wstępne

Podstawowa wiedza z zakresu mikroekonomii i makroekonomii, finansów przedsiębiorstw.

Zakres tematyczny

Wykład: Podstawowe zasady i etapy inwestowania. Podstawy koncepcyjne i najważniejsze zasady analizy fundamentalnej. Podstawowe elementy składowe analizy fundamentalnej. Wycena papierów wartościowych. Sprawozdania finansowe jako źródło danych w analizie fundamentalnej. Analiza wskaźnikowa w analizie fundamentalnej. Analiza fundamentalna a analiza techniczna.

Laboratorium: Analiza makroekonomiczna jako element składowy analizy fundamentalnej. Sprawozdania finansowe jako źródło danych w analizie fundamentalnej. Analiza sektorowa i sytuacyjna przedsiębiorstwa. Wskaźniki rynku kapitałowego wykorzystywane przy analizie fundamentalnej. Wycena akcji spółki. Analiza fundamentalna a analiza techniczna.

Metody kształcenia

Wykład konwencjonalny i problemowy, metoda przypadków. Laboratorium: praca w grupach, przedstawianie przygotowanych wcześniej prezentacji tematycznych, dyskusja, „burza mózgów”, „giełda pomysłów”, gry symulacyjne. Podczas laboratorium studenci będą przeprowadzali analizę fundamentalną wybranych spółek giełdowych notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych.

Efekty uczenia się i metody weryfikacji osiągnięcia efektów uczenia się

Opis efektu	Symbole efektów	Metody weryfikacji	Forma zajęć
Student definiuje etapy analizy fundamentalnej.	K_W01 K_W04	- aktywność w trakcie zajęć - przygotowanie referatu - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	- Wykład - Laboratorium
Student potrafi zinterpretować dla celów analizy fundamentalnej podstawowe wskaźniki rynku kapitałowego.	K_U02	- obserwacja i ocena aktywności na zajęciach - przygotowanie referatu - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	Laboratorium

Opis efektu	Symbole efektów	Metody weryfikacji	Forma zajęć
Student prowadzi dyskusje w grupach, dotyczące przygotowanych wcześniej wspólnie z innymi studentami prezentacji	K_K02	- aktywność w trakcie zajęć - odpowiedź ustna - przygotowanie referatu - zaliczenie - ustne, opisowe, testowe i inne	Laboratorium

Warunki zaliczenia

Warunkiem zaliczenia laboratorium (K_W01, K_U02, K_K02) jest opracowanie i przedstawienie w grupach prezentacji związanych z analizą fundamentalną przy wykorzystaniu podstawowych zagadnień teoretycznych przedstawionych na wykładzie oraz przykładów praktycznych. Liczbę uzyskanych punktów członkowie grupy dzielą sami zgodnie z indywidualnym wkładem pracy do prezentacji. Ocena z laboratorium będzie w 50% zależała od otrzymanych punktów za przygotowaną prezentację i w 50% z aktywności na poszczególnych zajęciach.

Warunkiem zaliczenia wykładów (K_W04) jest pozytywne zaliczenie w formie ustnej składającej się z pięciu pytań (od 50% do 60% dostateczny; powyżej 60% do 70% dostateczny plus; powyżej 70% do 80% dobry; powyżej 80% do 90% dobry plus, powyżej 90% bardzo dobry). Wynik egzaminu stanowić będzie ocenę wiedzy. Na ocenę końcową składa się ocena z wykładu (50%) i ocena z laboratorium (50%).

Literatura podstawowa

1. Borowski K., *Analiza fundamentalna. Metody wyceny przedsiębiorstwa*, Difin, Warszawa 2014.
2. Czekąła M., *Analiza fundamentalna i techniczna*, Wydawnictwo AE, Wrocław 1998.
3. Jajuga K., Jajuga T., *Inwestycje. Instrumenty. Aktywa niefinansowe. Ryzyko finansowe. Inżynieria finansowa*, PWN, Warszawa 2008.
4. Kowalke K. *Analiza fundamentalna wykorzystanie na rynku akcji w Polsce*, CeDeWu, Warszawa 2018.
5. Pieloch - Babiarz A., Sajnog A., *Analiza fundamentalna*, Wydawnictwo Uniwersytetu Łódzkiego, Łódź 2016.
6. Ritchie J. C., *Analiza fundamentalna*, WIG-Press, Warszawa 1997.
7. Siwiec D. , *Nowoczesny inwestor*, Big City Broker, Warszawa 2020.
8. Starzeński O., *Analiza rynków finansowych*, C.H. Beck, Warszawa 2011.
9. Strony internetowe o GPW: <https://www.gpw.pl> <https://gragieldowa.pl> <https://www.biznesradar.pl>

Literatura uzupełniająca

1. Bulkowski T.N., *Fundamental Analysis and Position Trading: Evolution of a Trader*, John Wiley&Sons Inc., New Jersey 2013.
2. Czekaj J. (red.), *Rynki, instrumenty i instytucje finansowe*, PWN, Warszawa 2008.
3. Jajuga K., *Podstawy inwestowania na Giełdzie Papierów Wartościowych*, Wyd. GPW, Warszawa 2010.
4. Maliński T., *Giełda Papierów Wartościowych dla bystrzaków*, Helion, Gliwice 2015.
5. Ostrowska E., *Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny*, C.H. Beck, Warszawa 2011.
6. Reilly F., Brown K., *Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem*, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2001.
7. Zaremba A., *Giełda. Podstawy inwestowania*, Helion, Gliwice 2014.

Uwagi

Zmodyfikowane przez dr Zbigniew Binek (ostatnia modyfikacja: 05-05-2021 15:09)

Wygenerowano automatycznie z systemu SylabUZ