**Nazwa przedmiotu:**

Analiza finansowa z wykorzystaniem arkusza kalkulacyjnego i Visual Basic for Applications

**Koordynator przedmiotu:**

dr Paweł Neumann

**Status przedmiotu:**

Fakultatywny ograniczonego wyboru

**Poziom kształcenia:**

Studia I stopnia

**Program:**

Ekonomia

**Grupa przedmiotów:**

Obieralne

**Kod przedmiotu:**

SIE 34.2/1

**Semestr nominalny:**

5 / rok ak. 2009/2010

**Liczba punktów ECTS:**

3

**Liczba godzin pracy studenta związanych z osiągnięciem efektów uczenia się:**

**Liczba punktów ECTS na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich:**

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

**Liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje w ramach zajęć o charakterze praktycznym:**

**Formy zajęć i ich wymiar w semestrze:**

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład:  | 30h |
| Ćwiczenia:  | 0h |
| Laboratorium:  | 0h |
| Projekt:  | 0h |
| Lekcje komputerowe:  | 0h |

**Wymagania wstępne:**

Przedmioty wprowadzające - technologia informacyjna, matematyka, statystyka opisowa, rachunkowość, analiza działalności gospodarczej (Financial Analysis)

**Limit liczby studentów:**

**Cel przedmiotu:**

Celem nauczania przedmiotu jest zapoznanie studenta z praktycznymi aspektami analizy zagadnień finansowych w oparciu o arkusz kalkulacyjny Excel i Visual Basic for Applications, wdrażanie metod analitycznych i ilościowych w dziedzinie finansów.

**Treści kształcenia:**

Wykłady:
1.Wprowadzenie i prezentacja podstawowych funkcji: statystyczne, finansowe, matematyczne, wyszukiwania i adresu, tabel przestawnych, regresji. [2W]
2.Aplikacja modelu finansowego: bilans, rachunek zysków i strat, sprawozdanie z przepływu środków pieniężnych [2W]
3.Analiza kapitału obrotowego i przepływu finansowego oraz analiza wskaźnikowa [2W]
4.Kryteria decyzyjne dla analizy przedsiębiorstwa, analiza wrażliwości modelu finansowego i planowanie zysku [2W]
5.Decyzje inwestycyjne w niestabilnych warunkach finansowych (analiza wielokryterialna, przedziały ufności) [2W]
6.Wykorzystanie funkcji bazodanowych i raportów oraz wykresów przestawnych do analizy zapasów, należności [4W]
7.Automatyzacja zadań przy użyciu makr (kodu VBA) [6W]
8.Wykorzystanie zaawansowanych funkcji analizy danych w badaniu szeregów czasowych (na bazie danych GUS, NBP) [6W]
9.Analiza inwestycji finansowych, w tym związanych z rynkiem papierów wartościowych[4W]

**Metody oceny:**

 Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest przystąpienie do Zaliczenia, prowadzonego przez Wykładowcę.
1.Forma i przebieg Zaliczenia:
-Samodzielne przygotowanie tematu analitycznego podanego przez Wykładowcę (w wersji elektronicznej)
-Ocena pracy Studenta, podanie sugestii i możliwości rozwiązań zaistniałych problemów lub uzgodnienie rozbudowy analitycznej badanego tematu (konsultacje)
-Weryfikacja pracy Studenta, ewentualna dyskusja na tematy teoretyczne dotyczące metodologii analizy
2.Czynniki decydujące o zaliczeniu przedmiotu i wpływające na ocenę końcową (jednocześnie wszystkie wymienione czynniki):
-uczestnictwo w zajęciach
-aktywność na zajęciach (w tym rozwiązywanie i dyskusja nad wybranymi case study)
3.Zasady oceniania
Przedział dolny Przedział górny Ocena
0,00% 54,9% ndst
55,0% 64,9% dst
65,0% 74,9% dst+
75,0% 84,9% db
85,0% 92,4% db+
92,5% 100,0% bdb

**Egzamin:**

**Literatura:**

Literatura podstawowa:
1. Jinjer Simon, Excel Profesjonalna Analiza i Prezentacja Danych, Helion 2006
2. Mary Jackson, Mike Staunton, Zaawansowane modele finansowe z wykorzystaniem Excela i VBA, Helion 2005
3. Julitta Korol, Visual Basic w Excelu 97, MIKOM 1998
4. Lisa A Bucki, Jim Kinlan, Scott Tucker, Excel 97, narzędzia praktyczne, MIKOM 1998
5. Conrad Carlberg, Analiza finansowa z zastosowaniem Excela, AZ Druk 1999
Literatura uzupełniająca:
1. J. Kowalczyk, A. Kusak: Decyzje finansowe firmy. Metody Analizy, Wydawnictwo C.H.BECK, Warszawa 2006 r.
2. L. Bednarski, R. Borowiecki, J. Duraj, E. Kurtys, T. Waśniewski, B. Wersty, Analiza ekonomiczna przedsiębiorstwa, Wydawnictwo AE im. Oskara Langego, Wrocław 2001
3. W. Bień, Zarządzanie finansami przedsiębiorstw, Difin
4. L. Bednarski, Analiza finansowa w przedsiębiorstwie, PWE
10. E. Nowak, Metody statystyczne w analizie działalności przedsiębiorstw, PWE 2001
11. J. Podgórski, J. Jóźwiak: Statystyka od podstaw, PWE 1994
12. M. Cieślak: Prognozowanie gospodarcze, WAE we Wrocławiu, Wrocław 1996

**Witryna www przedmiotu:**

**Uwagi:**

## Efekty przedmiotowe