



Przedmiot: Prognozowanie finansowe				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 2	Rok: 1	Wymiar godzin: 30	Punkty ECTS:
Forma zaliczenia: egzamin	Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski	
Kierunek: Finanse i Rachunkowość		Tryb: stacjonarne		Rodzaj: magisterskie
Specjalność: Wszystkie specjalności				
Katedra: Katedra Prognoz i Analiz Gospodarczych				
Stopień naukowy wykładowcy: dr hab. prof UE		Imię i nazwisko wykładowcy: Ireneusz Kuroпка		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

Znajomość analizy finansowej, ekonometrii, statystyki, excella.

Program przedmiotu:

- 1.2. Problemy prognostyczne w bankowości i finansach. Podstawowe pojęcia prognostyczne. Funkcje prognoz. Dane wykorzystywane w prognozowaniu. Procedura budowy prognoz. Etapy prognozowania. Metody prognozowania.
3. Modele szeregów czasowych. Model średniej ruchomej, prosty model wygładzania wykładniczego.
4. Elementy analizy technicznej: założenia. Indeksy giełdowe. Formułowanie prognoz jakościowych: średnie kroczące (prosta, ważona i wykładnicza), wstęga Bollingera, sygnały kupna i sprzedaży.
5. Prognozowanie na podstawie modeli tendencji rozwojowej: wybór postaci funkcji. Prognoza punktowa i przedziałowa. Prognoza z poprawką.
6. Modele ARIMA. Symulacja z wykorzystaniem modeli trendu: ekstrapolacja według różnych funkcji trendu. Studia przypadków.
7. Prognozowanie zjawisk z wahaniami sezonowymi: metoda wskaźników, analiza harmoniczna, model Wintersa.
8. 9. Prognozowanie z wykorzystaniem modeli ekonometrycznych. Założenia prognostyczne. Dobór zmiennych do modelu prognostycznego. Ocena jakości prognoz. Modele autoregresyjne i wielorównaniowe. Zmienne jakościowe w modelach ekonometrycznych.
10. Zmienne syntetyczne: pomiar zjawisk złożonych. Wykorzystanie zmiennych syntetycznych w prognozowaniu.
11. Analogowe metody prognozowania: analogie historyczne i przestrzenno-czasowe. Procedura budowy prognoz.
12. Prognozowanie sytuacji finansowej przedsiębiorstwa.
13. Heurystyczne metody prognozowania. Prognozowanie koniunktury gospodarczej. Test koniunktury.
14. Budowa scenariuszy i prognozy ostrzegawcze. Konstrukcja i rodzaje scenariuszy. Prognozy ostrzegawcze.
15. Monitorowanie prognoz. Kryteria wyboru metody prognozowania. Weryfikacja polskich prognoz makroekonomicznych-studia przypadków.

Metody dydaktyczne:

wykład

Cele przedmiotu:

Celem kursu jest przekazanie słuchaczom wiadomości o metodach prognozowania oraz wykształcenie umiejętności: dostrzegania sytuacji prognostycznych, formułowania hipotez badawczych dotyczących mechanizmu zmian zmiennych prognozowanych, wyboru metody prognozowania właściwej dla danej zmiennej, sporządzenia prognoz wariantowych i interpretacja wyników obliczeń oraz ocena stopnia zaufania do prognoz.

Warunki zaliczenia:

egzamin pisemny

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. Czekala M., Analiza techniczna i fundamentalna. Wrocław. AE Wrocław 1997.
2. Dittmann P., Prognozowanie w przedsiębiorstwie. Wolters Kluwer Polska, Kraków 2006.
3. Prognozowanie gospodarcze. Metody i zastosowanie. Red. M. Cieślak. Warszawa, PWN 2005.

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

1. Metody prognozowania. Zbiór zadań. Red. B. Radzikowska. AE Wrocław 2001.
2. Ekonometria. Metody i analiza problemów ekonomicznych. Red. K. Jajuga. Wrocław. AE 1998.