**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:**

IE 37.2/1

**Semestr nominalny:**

5 / rok ak. 2012/2013

**Liczba punktów ECTS:**

3

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

75 h: wykład 30, przygotowanie do zajęć 10, przygotowanie do zaliczenia 15, przygotowanie pracy 10, konsultacje 5, zaliczenia poprawkowe 5

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

1,2 ECTS - wykłady
0,2 ECTS - konsultacje
0,2 ECTS - zaliczenia poprawkowe

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

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

0

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

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

**Wymagania wstępne:**

Przedmioty wprowadzające:
1. Technologia informacyjna
2. Matematyka
3. Statystyka opisowa
4. Rachunkowość
5. Analiza ekonomiczna

**Limit liczby studentów:**

Wykład: min. 15 osób

**Cel przedmiotu:**

" Cel główny: zapoznanie Studenta z praktycznymi aspektami analizy finansowej i programowania w środowisku Visual Basic w oparciu o arkusz kalkulacyjny Excel.
Celem nauczania przedmiotu jest przygotowanie studenta analizy zagadnień finansowych w oparciu o arkusz kalkulacyjny Excel i Visual Basic for Applications, wdrażanie metod analitycznych i ilościowych w dziedzinie finansów, w tym w szczególności: sporządzania sprawozdań finansowych pro forma, kalkulacji cash flow, a na tej podstawie tworzenia modelu finansowego, użytkowe programowanie w VB (pętle, tabele dynamiczne, proste algorytmy symulacyjne dla potrzeb np. analizy wrażliwości), ocena efektywności inwestycji finansowych uwzględniających metodologię wyceny aktywów kapitałowych CAPM."

"

**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, zarządzanie kapitałem obrotowym [6W]
3. Kryteria decyzyjne dla analizy przedsiębiorstwa, analiza wrażliwości modelu finansowego i planowanie zysku [4W]
4. Automatyzacja zadań przy użyciu makr (kodu VBA) [8W]
5. Analiza szeregów czasowych: średnia ruchoma, model wyrównywania wykładniczego [4W]
6. Aplikacja modelu CAPM [6W]

**Metody oceny:**

"1. Forma i przebieg zaliczenia przedmiotu - przygotowanie pisemnych opracowań: podstawowe funkcje finansowe + pytania problemowe ; model finansowy + przygotowanie prognozy w formie sprawozdań finansowych pro forma; procedura VBA; model CAPM.
2. Zasady oceniania
Opracowanie 1, 2 i 4 - indywidualnie, maksymalna liczba punktów 3 x 10 Opracowanie 3 (procedura VBA) - możliwość wykonania w zespołach (co do zasady dwuosobowych) - maksymalna liczba punktów 20 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:**

nie

**Literatura:**

Literatura podstawowa:
1. Jinjer Simon, Excel Profesjonalna Analiza i Prezentacja Danych, Helion 2006
2. Mary Jackson, Mike StauntonZaawansowane 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
6. J. Kowalczyk, A. Kusak: Decyzje finansowe firmy. Metody Analizy, Wydawnictwo C.H.BECK, Warszawa 2006 r.
Literatura uzupełniająca:
1. L. Bednarski, R. Borowiecki, J. Duraj, E. Kurtys, T. Waśniewski, B. Wersty, Analiza ekonomiczna przedsiębiorstwa, Wydawnictwo AE im. Oskara Langego, Wrocław 2001
2. W. Bień, Zarządzanie finansami przedsiębiorstw, Difin
3. L. Bednarski, Analiza finansowa w przedsiębiorstwie, PWE
4. E. Nowak, Metody statystyczne w analizie działalności przedsiębiorstw, PWE 2001
5. J. Podgórski, J. Jóźwiak: Statystyka od podstaw, PWE 1994
6. M. Cieślak: Prognozowanie gospodarcze, WAE we Wrocławiu, Wrocław 1996"

**Witryna www przedmiotu:**

www.knes.pw.plock.pl

**Uwagi:**

brak

## Efekty przedmiotowe

### Profil ogólnoakademicki - wiedza

**Efekt W23:**

Zna podstawy tworzenia algorytmów niezbędnych dla budowy prostych modeli wykorzystywanych w implementowaniu modeli z zakresu finansów przedsiębiorstw.

Weryfikacja:

Pisemne opracowania - zadania projektowe, aktywność w trakcie zajęć

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_W23

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_W06

**Efekt W24:**

zna funkcjonalność pakietu Office (dla zaawansowanych) i kodu VBA.

Weryfikacja:

Pisemne opracowania - zadania projektowe, aktywność w trakcie zajęć

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_W24

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_W06

### Profil ogólnoakademicki - umiejętności

**Efekt U05:**

 Potrafi samodzielnie pozyskać dane z dostępnych źródeł, przetworzyć je na potrzeby analizy i prezentacji, potrafi doprowadzić dane źródłowe do porównywalności w czasie i przestrzeni, wykorzystując zaawansowane funkcje Office oraz kod VBA

Weryfikacja:

Pisemne opracowania - zadania projektowe, aktywność w trakcie zajęć

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_U05

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_U02

**Efekt U32:**

Potrafi napisać algorytmy niezbędne do budowy prostego modelu finansowego przedsiębiorstwa, potrafi zaimplementować proste makro niezbędne dla wykonania procedury symulacyjnej i analitycznej.

Weryfikacja:

Pisemne opracowania - zadania projektowe, aktywność w trakcie zajęć

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_U32

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_U07

**Efekt U33:**

Potrafi wykorzystywać zaawansowane funkcje wbudowane w pakiecie Office (bazodanowe, finansowe, statystyczne) oraz tworzyć własne przy użyciu kodu VBA, w celu analizy danych w postaci szeregów czasowych bądź danych finansowych (w tym w postaci wielowymiarowych tabel).

Weryfikacja:

Pisemne opracowania - zadania projektowe, aktywność w trakcie zajęć

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_U33

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_U07

### Profil ogólnoakademicki - kompetencje społeczne

**Efekt K13:**

Wykorzystuje umiejętność adaptacji stosowanych narzędzi, zmieniających się uwarunkowań rynkowych poprzez aktualizację wiedzy w tym zakresie oraz modyfikacji procedur VBA.

Weryfikacja:

Przygotowanie się do zajęć i prezentacja efektów samodzielnej pracy na forum grupy, dyskusja.

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_K13

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_K04

**Efekt K08:**

Wykazuje kreatywną postawę w zakresie rozwiązywania zadań projektowych poprzez samodzielne pozyskanie danych, wstępną ich analizę oraz ocenę. Potrafi pracować samodzielnie lub w grupie oraz być odpowiedzialnym za efekt wykonanej indywidualnie bądź zespołowo pracy.

Weryfikacja:

Przygotowanie się do zajęć i prezentacja efektów samodzielnej pracy na forum grupy, dyskusja.

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_K08

**Powiązane efekty obszarowe:** S1A\_K07