

ABSTRAKT

mgr inż. Marcin Stanuch

“Model oceny inwestycji giełdowych oparty na rozwiązaniach informatyczno-ekonometrycznych”

W niniejszej rozprawie przedstawiono analizę i ocenę oddziaływania wybranych czynników kształtujących potencjalną wartość rynkową akcji. W badaniach skupiono się na takich aspektach jak: analiza finansowa, analiza techniczna, analiza wskaźnikowa, wybrane aspekty makroekonomiczne, jak również elementy związane z ryzykiem inwestycyjnym oraz wypłatą dywidend. Głównym celem projektu badawczego było stworzenie modelu oceny inwestycji giełdowych pozwalającego na sprawne podejmowanie działań w zakresie ulokowania kapitału w wybrane spółki notowane na GPW w Warszawie. Cele szczegółowe obejmowały m.in. identyfikację i klasyfikację czynników wpływających na wartość kursu akcji, a także zbadanie powiązań pomiędzy wybranymi czynnikami, a wahaniami kursu akcji. Rozprawa ma charakter teoretyczno-empiryczny i składa się z pięciu rozdziałów, w których przeprowadzono przegląd literatury oraz wykonano badania własne. Przegląd literatury pozwolił na zbudowanie podstawy merytorycznej, która stanowiła punkt wyjścia do części badawczej. W części empirycznej zastosowano metody analizy ilościowej, w tym modele regresji, testy korelacji oraz testy przyczynowości, które umożliwiły weryfikację postawionych hipotez badawczych. Wyniki badań dostarczyły cennych informacji dla praktyki inwestycyjnej, a także pozwoliły na sformułowanie wniosków dla inwestorów dotyczących strategii opartych na analizie finansowej i technicznej.