

PRZYKŁADOWA TEMATYKA PRAC LICENCJACKICH

- Efekty stycznia na rynku akcji/funduszy inwestycyjnych/innych klas aktywów.
- Efekty „sell-in-May-and-go-away” na rynku akcji/funduszy inwestycyjnych/innych klas aktywów.
- Rajd Świętego Mikołaja na rynku akcji/funduszy inwestycyjnych/innych klas aktywów.
- Inne efekty sezonowe na rynkach finansowych
- Długoterminowe anormalne stopy zwrotu po pierwszych/kolejnych ofertach publicznych na rynku akcji/obligacji korporacyjnych.
- Natychmiastowe stopy zwrotu po debiutach giełdowych.
- Krótkoterminowe/ długoterminowe reakcje cenowe na splity / respity / fuzje i przejęcia / skupy akcji własnych / wezwania do sprzedaży / wypłaty lub zmiany dywidend/ publikacje rekomendacji maklerskich / publikacje wyników finansowych.
- Efekt momentum na rynku akcji / surowców / walut / funduszy / różnych klas aktywów.
- Efekt momentum szeregów czasowych (*time-series momentum*) na rynku akcji / surowców / walut / funduszy / różnych klas aktywów.
- Opóźnione momentum (*intermediate momentum*, Novy-Marx [2012]) na rynku akcji / surowców / walut / funduszy / różnych klas aktywów.
- Efekt długoterminowego / krótkoterminowego odwrócenia (*long-term reversal, short-term reversal*) na rynku akcji / surowców / walut / funduszy / różnych klas aktywów.
- Inwestowanie w wartość i we wzrost na rynku akcji.
- Wpływ stopy dywidendy / zmian poziomu dywidend / zmian stopy dywidendy na stopy zwrotu na rynku akcji.
- Inwestowanie w jakość na rynku akcji.
- Emisje akcji a stopy zwrotu (*composite equity issuance, net stock issuance*).
- Wiek spółek a stopy zwrotu (Jiang i in., 2005).
- Płynność na rynku akcji a przyszłe stopy zwrotu.
- Anomalia niskiego ryzyka na rynku akcji / obligacji / surowców/ walut / funduszy.
- Wartość na rażona na ryzyko a przyszłe stopy zwrotu na rynkach finansowych.
- Skośność i kurtoza a stopy zwrotu na rynku akcji.
- Strategie inwestycyjne bazujące na średnich ruchomych na rynkach akcji / surowców / obligacji/ funduszy inwestycyjnych / walut/ różnych klas aktywów.
- Efekt 52 tygodni na rynkach akcji / surowców / obligacji/ funduszy inwestycyjnych / walut/ różnych klas aktywów (George i Hwang, 2004).
- Inny efekt stycznia (*the other January effect*, Cooper i in. [2006]).
- Strategie inwestycyjne bazujące na rekomendacjach maklerskich.
- Efekt wielkości spółki na rynku akcji.
- Efekt niskiej ceny nominalnej na rynku akcji.
- Efekt „spółek grzesznych” (*sin stocks*) na rynku akcji.
- Prognozowanie stop zwrotu z funduszy inwestycyjnych na podstawie ich wielkości / wieku / historycznych wyników / innych czynników.