

Ekonometria Finansowa

Informacje Organizacyjne

mgr Paweł Jamer¹

11 października 2015

¹pawel.jamer@gmail.com

Wymagania wstępne

Wymagania wstępne:

- podstawy programowania (r-language),
- rachunek prawdopodobieństwa,
- statystyka matematyczna,
- ekonometria dynamiczna.

Zakres materiału

- 1 Zarys zagadnień związanych z rynkiem finansowym.
- 2 Jednowymiarowe modele szeregów czasowych.
- 3 Wielowymiarowe modele szeregów czasowych.
- 4 Dekompozycja szeregów czasowych.
- 5 Nieliniowe modele szeregów czasowych.
- 6 Teoria efektywności informacyjnej rynku.
- 7 Metody pomiaru ryzyka.
- 8 Analiza portfelowa.

Zaliczenie (punkty)

❶ Teoria (30 punktów):

❶ kartkówki (15 punktów):

- na początku każdych zajęć,
- obowiązuje materiał z zajęć poprzednich,

❷ egzamin teoretyczny (15 punktów):

- część egzaminu końcowego,
- pytania otwarte z całości teorii.

❷ Praktyka (70 punktów):

❶ projekty (30 punktów):

- dwa w ciągu semestru,
- przydzielone na drugich i szóstych zajęciach,
- czas na oddanie to około 30 dni,

❷ egzamin praktyczny (40 punktów):

- część egzaminu końcowego,
- zadania rozwiązywane na komputerach.

❸ Szeroko pojęta aktywność:

- ❶ zadania dodatkowe, projekty, prezentacje,
- ❷ inwencja własna.

Zaliczenie (ocena końcowa)

Ocena końcowa:

- **5.0** → od **91** punktów,
- **4.5** → od **81** do **90** punktów,
- **4.0** → od **71** do **80** punktów,
- **3.5** → od **61** do **70** punktów,
- **3.0** → od **51** do **60** punktów.

Warunki dodatkowe:

- minimum 51 punktów z części formalnej (teoria + praktyka).

- ❶ Banaszczak-Soroka U., Dybał M., Homa M., Jakubowski S., Zawadzka P.; Rynki finansowe: organizacja, instytucje, uczestnicy; C. H. Beck, Warszawa 2014.
- ❷ Jajuga K., Jajuga T.; Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa; PWN, Warszawa 2014.
- ❸ Osińska M.; Ekonometria Finansowa; PWE, Warszawa 2006.
- ❹ Starzeński O.; Analiza rynków finansowych; C. H. Beck, Warszawa 2011.
- ❺ ...

<http://jamer.pl>