

Ekonometria Finansowa

Informacje Organizacyjne

mgr Paweł Jamer¹

Doktorant, Katedra Ekonometrii i Statystyki SGGW
Ekspert ds. Modelowania Danych, Polskie Technologie
Konsultant Zewnętrzny, Polkomtel

22 października 2016

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 Teoria efektywności informacyjnej rynku.
- 3 Dekompozycja szeregów czasowych.
- 4 Jednowymiarowe modele finansowych szeregów czasowych.
- 5 Wielowymiarowe modele szeregów czasowych.
- 6 Nieliniowe modele szeregów czasowych.
- 7 Metody pomiaru ryzyka.
- 8 Analiza portfelowa.

- ❶ **Teoria** (30 punktów):
 - ❶ kartkówki (15 punktów),
 - ❷ egzamin teoretyczny (15 punktów).
- ❷ **Praktyka** (70 punktów):
 - ❶ projekt (30 punktów),
 - ❷ egzamin praktyczny (40 punktów).
- ❸ **Szeroko pojęta aktywność:**
 - ❶ zadania dodatkowe, projekty, prezentacje,
 - ❷ inwencja własna.

Kartkówki:

- na początku każdych zajęć,
- obowiązuje materiał z zajęć poprzednich,
- pytania odtwórcze oraz problemowe.

Egzamin teoretyczny:

- część egzaminu końcowego,
- obowiązuje materiał z całego semestru,
- pytania odtwórcze oraz problemowe,
- ...nie, nie będzie listy zagadnień na egzamin.

Projekt:

- każdy student analizuje przypisany mu szereg czasowy,
- przypisanie szeregów do studentów będzie ulegać zmianom,
- wyniki analiz będą udostępniane publicznie (github.com),
- analizy będą wykonywane w R z wykorzystaniem RMarkdown,
- kryteria oceniania będą podawane razem z treścią zadania,
- każdy student będzie zobowiązany ocenić trzy prace innych,
- losowe prace będą sprawdzane również przez prowadzącego.

Egzamin praktyczny:

- część egzaminu końcowego,
- obowiązuje materiał z całego semestru,
- zadania rozwiązywane na komputerach,
- wolno korzystać z wydrukowanych kodów R.

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),
- zaliczony egzamin końcowy.

- 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 Witkowska D., Matuszewska-Janica A., Kompa K.; Wprowadzenie do ekonometrii dynamicznej i finansowej; Wydawnictwo SGGW, Warszawa 2012.
- ❻ ...

<http://jamer.pl>