

Modelowanie rynków finansowych

Konwersatorium FIR 2019/2020

Ryszard Kokoszcyński

Podstawowe informacje o zajęciach i zasady zaliczania

Zajęcia mają generalnie charakter praktyczny, dlatego też na ich zaliczenie składają się trzy elementy:

- (i) Aktywność na zajęciach (z wagą 10%)
- (ii) Krytyczna prezentacja artykułu z osobno przedstawionej listy lub zaproponowanego przez prezentującego/ prezentujących i zaakceptowanego przez prowadzącego przygotowywana przez jedno- lub dwuosobowe zespoły (z wagą 30%)
- (iii) Wykonanie samodzielnego ćwiczenia modelowego na temat inny niż przedstawiony w ramach (ii) w jedno- lub dwuosobowym zespole (z wagą 60%). Tematyka ćwiczenia powinna być zbieżna z tematami zawartymi w sylabusie, tj. dotyczyć następujących zagadnień: błędzenie przypadkowe, efektywność rynków finansowych, modele cen (stóp zwrotu z) akcji lub innych aktywów, modele krzywej dochodowości na rynku obligacji, modele kursu walutowego, modelowanie zmienności finansowych szeregów czasowych, modelowanie instrumentów pochodnych i ryzyka itp. Temat powinien zostać wcześniej zaakceptowany przez prowadzącego.

O przydzieleniu tematów z (ii) i (iii) poszczególnym zespołom decydowała będzie kolejność zgłoszeń. Zgłoszenia składu zespołu i preferencji co do tematów prezentacji krytycznej i ćwiczenia modelowego należy zgłaszać na adres mailowy prowadzącego (tj. rkokoszczynski@wne.uw.edu.pl) nie później niż do 15.10.2019 w przypadku (ii) i 28.10 w przypadku (iii).

Prezentacje (ii) zaczną się na zajęciach 21 października. Prezentacje (iii) zaczną się najprawdopodobniej na przełomie listopada i grudnia.

Projekt (iii) powinien mieć wyraźnie sformułowaną hipotezę badawczą, krótki wstęp teoretyczny z odniesieniami do istotnej literatury, opis i źródło użytych danych, sformułowany model oraz wyniki empirycznej weryfikacji wyjściowej hipotezy wraz z komentarzem i wnioskami. Projekt będzie przedstawiony na zajęciach, a pisemny raport z jego realizacji (o objętości od 10 do 20 tysięcy znaków) przekazany prowadzącemu zajęcia. Badanie może zostać przeprowadzone przy pomocy dowolnego pakietu ekonometrycznego. Nie jest wymagane dołączanie do raportu kodów i listingu z pakietu, jednak autorzy muszą być gotowi do ich udostępnienia na życzenie prowadzącego.

Prezentacje należy przekazywać prowadzącemu (można mailem) nie później niż tydzień po ich przedstawieniu na zajęciach; raporty z badań powinny być złożone nie później niż do 31 stycznia 2020.

Taki charakter zajęć wymaga aktywnego uczestnictwa, dlatego też osoby, które będą miały więcej niż trzy nieobecności, nie będą klasyfikowane.

Raport z (iii) musi zawierać oświadczenie autorów zgodne z poniższym wzorem (druga strona raportu).

Oświadczenie autorów raportu:

Mając świadomość odpowiedzialności prawnej oświadczamy, że niniejsza praca zaliczeniowa została napisana przez nas samodzielnie i nie zawiera treści uzyskanych w sposób niezgodny z obowiązującymi przepisami prawa.

Oświadczamy również, że przedstawiona praca ani jej fragmenty nie są i nie były wykorzystywane do uzyskania zaliczenia innego przedmiotu w toku studiów na WNE UW (wyłączając badania na potrzeby pracy magisterskiej).

(data)

(podpisy)

