

Modelowanie rynków finansowych Konwersatorium IiE 2018/2019

dr J. Mycielski

Katedra Statystyki i Ekonometrii

ZASADY DOTYCZĄCE ZALICZENIA KONWERSATORIUM

1. Formą zaliczenia konwersatorium jest zaprezentowanie wybranego artykułu na zajęciach
 - Lista artykułów dostępna jest na stronie www.ekonometria.wne.uw.edu.pl w zakładce „Modelowanie Rynków Finansowych IiE”.
 - Zgłoszenia wybranego artykułu przyjmowane są od 12 października 2018 a o przydzieleniu artykułu decydować będzie kolejność zgłoszeń.
 - Wybrany artykuł należy zgłaszać elektronicznie do prowadzącego konwersatorium.
 - Osobom, które do 16 października 2018 nie zgłoszą artykułu zostanie on przydzielony przez prowadzącego zajęcia. Prezentacje artykułów rozpoczną się 13 listopada 2018.
 - Pisemne wersje prezentacji należy:
 - przesłać mailem najpóźniej do 13 stycznia 2019;
 - złożyć na portierni WNE najpóźniej do 13 stycznia 2019.
 - Pisemna wersja prezentacji powinna zawierać oświadczenie autora zgodne z wzorem (patrz oświadczenie przy projektach zaliczeniowych na str.2). Wersje bez dołączonego oświadczenia nie zostaną przyjęte.
2. wykonanie ćwiczenia modelowego w zespołach co najwyżej dwuosobowych. Tematyka modeli będzie zbieżna z blokami tematycznymi zawartymi w sylabusie, tj:
 - (a) błądzenie przypadkowe (random walk),
 - (b) efektywność rynków finansowych (słaba, półsilna, silna), bąble spekulacyjne
 - (c) modele cen akcji oparte na CAPM i APT,
 - (d) modele dla krzywej dochodowości (yield curve),
 - (e) modelowanie zmienności finansowych szeregów czasowych.
 - O przydzieleniu zagadnień do zespołów decydować będzie kolejność zgłoszenia. Zgłoszeni a składu osobowego zespołu oraz tematu projektu zaliczeniowego należy zgłaszać elektronicznie do prowadzącego konwersatorium. Osobom, które nie zrobią tego do 23 grudnia 2017 zagadnienia prac zostaną przydzielone przez prowadzącego zajęcia.

- Temat modelu musi dotyczyć innego bloku materiału niż prezentowany na zajęciach artykuł (o którym mowa w punkcie (1))
- Zespoły będą prezentowały wyniki swoich badań w dniach:
 - 2018-01-09/11 prezentacje #1
 - 2018-01-16/18 prezentacje #2
 - 2018-01-23/25 prezentacje #3
- Prowadzący oczekuje ponadto, że praca zaliczeniowa będzie miała wyraźnie sformułowaną hipotezę badawczą (zgodną z wybranym zagadnieniem), krótki wstęp teoretyczny wraz z odniesieniami do istotnej literatury, opis i źródło użytych danych, sformułowany model oraz wyniki empirycznej weryfikacji postawionej hipotezy wraz z komentarzem i wynikającymi z nich wnioskami. Wielkość takiej pracy z reguły powinna zamykać się w przedziale ok. 10000-20000 znaków. Z technicznego punktu widzenia badanie empiryczne może zostać przeprowadzone przy pomocy dowolnego pakietu ekonometrycznego. Nie jest wymagane dołączanie do projektu kodów i listingów z pakietu o raz użytych danych, jednak autorzy projektu powinni je udostępnić na życzenie prowadzącego.
- Ostateczne terminy ustalone są na:
 - 30 stycznia 2018 r. nadesłanie prac na adres osoby prowadzącej konwersatorium,
 - 31 stycznia 2018 r. złożenie papierowej wersji pracy w portierni WNE.
 - Poszczególne formy zaliczenia wchodzi do oceny końcowej z następującymi wagami:
 - * 40% prezentacja artykułu i pisemna wersja prezentacji;
 - * 60% prezentacja pracy zaliczeniowej i praca zaliczeniowa.
 - Projekty zaliczeniowe powinny zawierać oświadczenie autorów zgodne z poniższym wzorem. Oświadczenie to powinno się znaleźć na drugiej stronie projektu. Prace bez dołączonego oświadczenia nie zostaną przyjęte.

Oświadczenie autora/autorów pracy

Mając świadomość odpowiedzialności prawnej oświadczam(y), że niniejsza praca zaliczeniowa została napisana przeze mnie/nas samodzielnie i nie zawiera treści uzyskanych w sposób ni e zgodny z obowiązującymi przepisami prawa. Oświadczam(y) również, że przedstawiona praca zaliczeniowa, ani jej fragmenty nie są równoległe i nie były wcześniej wykorzystywane do uzyskania zaliczenia z innego przedmiotu w toku studiów na WNE UW (wyłączając badania na potrzeby pracy magisterskiej). Oświadczam(y) ponadto, że niniejsza wersja pracy jest identyczna z przesłaną wersją elektroniczną.

data podpis(y)