

Seminarium magisterskie 2010/2011

Tytuł seminarium: Modelowanie i prognozowanie procesów finansowych

Prowadzący seminarium: prof. UG, dr hab. Tadeusz W. Bolt, Katedra Ekonometrii

Krótką charakterystyka tematyki seminarium:

Ekonometria finansowa oferuje szeroki zestaw metod, które mogą być wykorzystane do modelowania finansowych szeregów czasowych. Interesującym przedmiotem badań ekonometrycznych, proponowanym na seminarium będzie analiza czynników wpływających na stopy zwrotu walorów notowanych na rynkach kapitałowych. Literatura przedmiotu wyróżnia trzy alternatywne podejścia do tego problemu:

1. budowa modeli z czynnikami makroekonomicznymi (model Sharpe'a, ogólny model wieloczynnikowy),
2. budowa modeli z czynnikami fundamentalnymi (modele typu BARRA),
3. budowa modeli z czynnikami statystycznymi (analiza czynnikowa, główne składowe).

Identyfikacja i testowanie wymienionych wyżej modeli dla akcji notowanych na GPW w Warszawie może być ambitnym i interesującym poznawczo zadaniem dla wielu prac magisterskich. Równie interesujące mogą być prace dotyczące prognozowania szeregów czasowych danych finansowych zarówno w oparciu o modele jednej zmiennej należące do klasy SARIMA jak również w oparciu o dynamiczne modele wektorowe.