

Seminarium magisterskie 2010/2011

Tytuł seminarium: Modelowanie i prognozowanie rynku finansowego

Prowadzący seminarium: prof. UG dr hab. Paweł Miłobędzki, Katedra Ekonometrii

Krótką charakterystyka tematyki seminarium:

Seminarium poświęcone jest funkcjonowaniu wybranych segmentów rynku kapitałowego, pieniężnego oraz ubezpieczeniowego. Uczestnictwo w seminarium przygotowuje do podjęcia samodzielnych analiz w zakresie wyceny akcji, obligacji oraz instrumentów pochodnych, konstruowania optymalnych portfeli inwestycyjnych, oceny efektywności funkcjonowania banków, instytucji wspólnego inwestowania oraz instytucji ubezpieczeniowych, a także prognozowania koniunktury, kursów walutowych oraz stóp procentowych. Przykładowe tematy prac magisterskich: Ocena atrakcyjności inwestowania w spółki giełdowe w oparciu o zmienne fundamentalne; Szacunki wartości zagrożonej dla portfela papierów wartościowych; Efektywność informacyjna Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. i jej rynków częściowych; Ryzyko sektorowe na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. w latach 1999-2009; Integracja polskiego rynku akcji z rynkami akcji wybranych krajów rozwiniętych; Wycena kontraktów terminowych na WIG 20; Ocena opłacalności inwestowania w jednostki uczestnictwa otwartych funduszy inwestycyjnych w Polsce; Ocena efektywności funkcjonowania towarzystw ubezpieczeniowych (banków) w Polsce za pomocą metody DEA; Analiza zależności między cenami kontraktów na miedź (aluminium, cynę, cynk, srebro) na Londyńskiej Giełdzie Metali; Struktura czasowa stóp procentowych na rynku depozytów międzybankowych w Polsce (na Londyńskim rynku międzybankowym); Parytet stóp procentowych w Polsce i wybranych krajach rozwiniętych; Krótkookresowa prognoza koniunktury na podstawie struktury terminowej stóp procentowych.