



<b>Przedmiot:</b> Metody estymacji parametrów rynkowych				
<b>Forma zajęć:</b> wykład	<b>Semestr:</b> 2	<b>Rok:</b> 1	<b>Wymiar godzin:</b> 30	<b>Punkty ECTS:</b> 3
<b>Forma zaliczenia:</b> zaliczenie na ocenę		<b>Typ przedmiotu:</b> do wyboru		<b>Język nauczania:</b> polski
<b>Kierunek:</b> Ekonomia			<b>Tryb:</b> stacjonarne	<b>Rodzaj:</b> magisterskie
<b>Specjalność:</b> Analityk rynku				
<b>Katedra:</b> Ekonomii Matematycznej				
<b>Stopień naukowy wykładowcy:</b> dr		<b>Imię i nazwisko wykładowcy:</b> Jerzy Stelmach		

**Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):**

Statystyka, Matematyka

**Program przedmiotu:**

1. Charakterystyki liczbowe struktury zbiorowości: miary zmienności, położenia, asymetrii, koncentracji i korelacji.
2. Charakterystyki liczbowe rozkładu: wartość oczekiwana, wariancja.
3. Rozkłady dyskretne: dwumianowy, Poissona.
4. Rozkłady ciągłe: normalny, t-Studenta, chi-kwadrat, F-Snedecora.
5. Twierdzenia graniczne. Rodzaje zbieżności. Prawa wielkich liczb.
6. Badanie własności estymatorów: obciążoność, efektywność, zgodność, dostateczność.
7. Metody estymacji: metoda momentów, MNK, MNW.

**Metody dydaktyczne:**

Metody podające i problemowe. Rozwiązywanie zadań.

**Cele przedmiotu:**

Głównym celem przedmiotu jest gruntowne przygotowanie studentów do przedmiotów specjalizacyjnych dotyczących analizy i zarządzania ryzykiem finansowym, w szczególności przedstawienie wiedzy z zakresu statystyki matematycznej oraz wykształcenie umiejętności w zakresie estymacji parametrów.

**Warunki zaliczenia:**

Pisemne kolokwium zaliczeniowe na koniec semestru

**Literatura podstawowa (do 4 pozycji):**

Ostasiewicz S., Rusnak Z., Siedlecka U.: Statystyka. Elementy teorii i zadania. Wrocław: Wyd. AE, 2006.  
Aczel A.: Statystyka w zarządzaniu. Warszawa: PWN, 2007.

**Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):**

Luszniewicz A., Słaby T.: Statystyka z pakietem komputerowym STATISTICA PL. Teoria i zastosowania. Warszawa: Wyd. C.H. Beck, 2008.