

Nazwa przedmiotu:	Analiza i modelowanie danych finansowych			
Forma: Laboratorium	Godzin: 30 Semestr: 8 Rok: 4	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 1	
Wydział: ZIF	Kierunek: Informatyka i Ekonometria	Tryb: stacjonarny Rodzaj: magisterskie		
Specjalność: Analiza danych				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Alicja Grzeszkowiak	alicja.grzeszkowiak@ue.wroc.pl	3680478	313Z

1. Wymagania wstępne

ekonomia, statystyka, ekonometria

2. Program przedmiotu

Metody badania i analizy wskaźników ekonomicznych.

Pomiar i analiza inflacji: mierniki CPI, PPI, inflacja bazowa.

Zastosowanie metod wielowymiarowej analizy statystycznej do analizy i prognozowania danych finansowych.

Ekonometryczne modelowanie rynków finansowych.

Modele zmiennych jakościowych stosowane w finansach i bankowości.

3. Metodyka zajęć

Laboratorium komputerowe z zastosowaniem pakietu statystycznej analizy danych. Nauczanie poprzez studia przypadków oraz zestawy zadań do samodzielnego rozwiązywania

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: poznanie metod ilościowych służących do badania i analizy danych finansowych. Umiejętności: interpretacja wskaźników ekonomicznych, praktyczne umiejętności zastosowania metod statystycznej analizy wielowymiarowej oraz metod ekonometrycznych do badania i prognozowania zjawisk finansowych

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

Gruszczyński M.: Modele i prognozy zmiennych jakościowych w finansach i bankowości, Oficyna Wydawnicza SGH, Warszawa 2002

Yamarone R.: Wskaźniki ekonomiczne. Przewodnik dla inwestora, Helion Gliwice 2006

Brzeszczyński J., Kelm R. Ekonometryczne modele rynków finansowych, WIG-Press, Warszawa 2002

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

Woźniak P.: Inflacja bazowa, CASE, Warszawa 2002

Lasek M. Data mining : zastosowania w analizach i ocenach klientów bankowych , Warszawa 2002

Osińska M. Ekonometria finansowa, PWE, Warszawa 2006