

Nazwa przedmiotu:	<b>Analiza i prognozowanie rozwoju gospodarczego</b>			
Forma: Laboratorium	Godzin: 20 Semestr: 7 Rok: IV	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS	
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	Albert Gardoń	albert.gardon@ue.wroc.pl	3680806	Z-418

### 1. Wymagania wstępne

Matematyka, Statystyka, Makroekonomia, Ekonometria

### 2. Program przedmiotu

Modele rynków finansowych, model Blacka-Scholesa, dyfuzja skokowa.

Estymacja parametrów dyfuzji skokowej na podstawie danych o wybranym instrumencie podstawowym.

Szacowanie cen instrumentów pochodnych metodą Monte Carlo.

Metody badania koniunktury gospodarczej: barometry koniunktury, testy koniunktury, modele ekonometryczne.

Zastosowanie metod taksonomicznych, statystycznych i ekonometrycznych do analizy i prognozowania koniunktury gospodarczej.

### 3. Metodyka zajęć

Laboratorium komputerowe, studium przypadków w oparciu o rzeczywiste dane. Zaliczenie na podstawie przygotowanych samodzielnie projektów.

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: poznanie metod służących do badania koniunktury gospodarczej, modelowania cen instrumentów finansowych oraz numerycznego wyliczania cen instrumentów pochodnych.

Umiejętności: praktyczne umiejętności zastosowania metod taksonomicznych, statystycznych i ekonometrycznych do badania i prognozowania koniunktury gospodarczej.

### Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Kowalewski G. Zarys metod badania koniunktury gospodarczej. Wrocław: UE 2009.
2. Prognozowanie gospodarcze: metody i zastosowanie. Praca zbiorowa pod red. M. Cieślak. Warszawa: PWN 2001.
3. Mancini C., Nonparametric Threshold Estimation for Models with Stochastic Diffusion Coefficient and Jumps, Scand.Act.J 2004
4. Weron A., Weron R. Inżynieria finansowa, Wyd. NT Wrocław 1997

### Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

3. D. Strahl i in. Modelowanie ekonometryczne z Excelem. Materiały pomocnicze do laboratoriów z ekonometrii. Wrocław, AE 2004.