



Przedmiot: Metody estymacji parametrów rynkowych				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 2	Rok: 1	Wymiar godzin: 18	Punkty ECTS: 3
Forma zaliczenia: zaliczenie na ocenę		Typ przedmiotu: do wyboru		Język nauczania: polski
Kierunek: Ekonomia			Tryb: niestacjonarne wieczorowe	Rodzaj: magisterskie
Specjalność: Analityk rynku				
Katedra: Ekonomii Matematycznej				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: 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.