

PROGRAM NAUCZANIA NA ROK AKADEMICKI 2007/2008

Przedmiot: **Mikroekonometria stosowana w badaniach marketingowych, analizach rynków finansowych i rynku pracy.**

Rodzaj studiów: studia stacjonarne jednolite magisterskie

System: dzienne

Kierunek, rok studiów: Informatyka i ekonometria (IV rok), Ekonomia (IV i V rok), Finanse i Rachunkowość (IV lub V rok)

Forma zajęć: konwersatorium

Liczba godzin: 30

Prowadzący: dr Paweł Baranowski (punkty 1-2, 8-14), dr Grzegorz Szafranski (punkty 3-7, 15)

CELE KSZTAŁCENIA:

Celem zajęć jest zapoznanie studentów z metodami analiz mikroekonometrycznych. Położymy przy tym nacisk na zastosowania omawianych metod, m. in. w badaniach marketingowych, analizie rynku pracy czy modelowaniu i prognozowaniu rynków finansowych. Omawiane problemy zilustrujemy licznymi przykładami zaczerpniętymi z literatury. Zaprezentujemy także przykłady własnych badań, do których dołączymy zbiory danych, dzięki czemu studenci będą mogli samodzielnie rozwiązać przedstawione problemy.

TREŚCI KSZTAŁCENIA:

1. Przypomnienie wybranych zagadnień z ekonometrii, finansów oraz ekonomii. Praca z danymi przekrojowymi.
2. Analiza rynku dóbr i usług konsumpcyjnych na podstawie danych indywidualnych i zagregowanych. Optymalna polityka cenowa w warunkach niedoskonałej konkurencji.
3. Wycena dóbr niejednorodnych w oparciu o modele hedoniczne.
4. Wprowadzenie do teorii portfela inwestycyjnego. Model CAPM jako narzędzie pomiaru ryzyka inwestycyjnego.
5. Rozwinięcia modeli CAPM i przykłady ich zastosowań w w praktyce inwestowania.
6. Hipoteza efektywności rynków finansowych i sposoby jej testowania na polskim rynku papierów wartościowych.
7. Wprowadzenie do modelowania ryzyka rynkowego. Modele wartości narażonej na ryzyko (VaR) i metody analizy wariancji stóp zwrotu (GARCH).
8. Modele zmiennych jakościowych: liniowy model prawdopodobieństwa, modele logitowe i probitowe. Interpretacja ocen parametrów. Miary dopasowania.
9. Przykłady zastosowanie modeli zmiennych jakościowych. Analizy rynku pracy w oparciu o jednostkowe dane BAEL; analiza scoringowa.
10. Uogólnienia modeli logitowych i probitowych (*ordered / multinomial logit i probit*). Zastosowanie: modelowanie funkcji reakcji banku centralnego; wybór produktu przez konsumenta.
11. Endogeniczność regresorów. Przykłady z zakresu marketingu oraz rynku pracy.
12. Dane ankietowe. Przegląd podstawowych problemów i metod badawczych.
13. Praktyka pracy z dużymi zbiorami danych. Zastosowanie w badaniach marketingowych. Efektywność reklamy i programów lojalnościowych.
14. Prezentacja i dyskusja rozwiązań problemów.
15. Prezentacja i dyskusja rozwiązań problemów. Podsumowanie zajęć. Test sprawdzający wiedzę.

WYKAZ UMIEJĘTNOŚCI:

Po zakończeniu wykładu student zna podstawowe narzędzia wykorzystywane w analizach mikroekonometrycznych. Jest w stanie podać przykłady zastosowań tych metod.

Potrafi przeprowadzić proste badanie marketingowe oraz analizę rynku pracy lub rynku finansowego. Ponadto potrafi przełożyć wyniki takiego badania na odpowiednie decyzje na szczeblu przedsiębiorstwa lub instytucji finansowej.

Zna podstawowe instrumenty finansowe stosowane w Polsce i na świecie. Potrafi zbudować modele CAPM i ART w oparciu o dostępne dane, a także zinterpretować i wykorzystać wyniki w praktyce inwestowania.

FORMA WERYFIKACJI WIEDZY:

Rozwiązanie wybranego problemu omawianego na zajęciach (w oparciu o dane udostępnione przez wykładowcę lub zebrane samodzielnie).

Test (ok. 30 minut) na ostatnich zajęciach.

LITERATURA:

1/ podstawowa: (**uwaga!** – aktualna)

1. K. Jajuga, T. Jajuga, *Inwestycje. Instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa*, PWN, Warszawa 2006.
2. G.S. Maddala, *Ekonometria*, PWN, Warszawa 2006.
3. K. Mazurek-Łopacińska, *Badania marketingowe. Teoria i praktyka*, PWN, Warszawa 2005.
4. W.F. Samuelson, S.G. Marks, *Ekonomia menedżerska*, PWE, Warszawa 1998.

2/ uzupełniająca:

1. Ch. Brooks, *Introductory Econometrics for Finance*, Cambridge, 2002, <http://www.cambridge.org/catalogue/catalogue.asp?isbn=9780521793674>
2. E. Fama, K. French, *The Capital Asset Pricing Model: Theory and Evidence*, 2004, <http://gsbwww.uchicago.edu/fac/finance/papers/capm2004a.pdf>
3. M. Gruszczyński, *Mikroekonometria. Zastosowania w finansach i bankowości*, referat dostępny na <http://www.ekonometria.org/>.
4. T. Kufel, *Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu Gretl*, PWN, Warszawa 2004.
5. B. Suhecki, *Kompletne modele popytu*, PWE, Warszawa 2006.