

# Úvodní informace do kurzu Finanční ekonometrie



**SLEZSKÁ  
UNIVERZITA**

OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

FIU/NPFEK

Doc. Ing. Iveta Palečková, Ph.D.

Katedra financí a účetnictví

# Kontakt

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- Doc. Ing. Iveta Palečková, Ph.D.
    - Kancelář A 403
    - tel: 596 398 211
    - e-mail: [paleckova@opf.slu.cz](mailto:paleckova@opf.slu.cz)
  
  - Konzultační hodiny
    - Pondělí 13:30 – 14:30
    - Úterý 10:30 – 12:30
-

# Struktura výkladu

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- Teorie a modely
  - Finanční časové řady a jejich charakteristiky
  - Modely jednorozměrných stacionárních časových řad
  - Modely jednorozměrných nestacionárních časových řad
  - Estimace parametrů modelu
  - Evaluace a diagnostická kontrola modelu
  - Kauzalita ve finančních časových řadách
  - Modely vícerozměrných časových řad
  - Kointegrace a modely typu Error Correction
  - Panelová regrese
  - Modely diskrétní volby
  - Nelinearita finančních časových řad a modely volatility
-

## Podmínky absolvování předmětu

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- případová studie (seminární práce)
  - závěrečná zkouška
-

# Případová studie

---

- Termín odevzdání: nejpozději do **10. 5. 2021**
  - Forma odevzdání – vložení do IS SLU
  - Volba tématu případové studie v IS SLU nejpozději do **30. 4. 2021**
  
  - Náležitosti práce:
    - Úvod (včetně cíle práce)
    - Teoretická část práce
    - Empirická část práce
    - Závěr
    - Seznam použitých pramenů a literatury
    - Přílohy
-

## Případová studie – témata

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- Regresní analýza a její aplikace
  - CAPM model
  - Analýza panelových dat a její aplikace
  - ARMA, ARIMA model a jeho aplikace
  - Kauzalita finančních řad (korelační analýza, Grangerova kauzalita) a aplikace
  - Kointegrační analýza (Johansenův kointegrační test) a aplikace
  - Model korekce chyb (VEC model) a jeho aplikace
  - VAR model a jeho aplikace
  - Modely volatility časových řad – ARCH a GARCH modely
-

## Závěrečná zkouška

---

- lze získat max. 60 bodů
  - termíny ve zkouškovém období
  - Forma zkoušky závisí na epidemiologické situaci (písemný test nebo prostřednictvím MS Teams)
  - struktura zkoušky:
    - praktické zpracování zadaných úkolů v ekonometrickém programu EViews
    - teoretická část - základní pojmy a souvislosti
-

## Bodové hodnocení aktivit

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

| Aktivita         | % z hodnocení | body          |
|------------------|---------------|---------------|
| Případová studie | 40 %          | 40 b.         |
| Zkouška          | 60 %          | 60 b.         |
| $\Sigma$         | <b>100 %</b>  | <b>100 b.</b> |

---



## Celkové hodnocení

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- A: 91 – 100 bodů
  - B: 81 – 90 bodů
  - C: 71 – 80 bodů
  - D: 61 – 70 bodů
  - E: 51 – 60 bodů
  - F: 0 – 50 bodů
-

# Literatura

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- **Veškerá látka probíraná na přednáškách a seminářích.**
  - Doporučená a povinná literatura dle sylabu.
-

# Organizace výuky

---



SLEZSKÁ  
UNIVERZITA  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

- Veškeré materiály ke studiu předmětu budou průběžně k dispozici v [is.slu.cz](https://is.slu.cz)
-



**SLEZSKÁ  
UNIVERZITA**  
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ  
FAKULTA V KARVINĚ

Děkuji za pozornost a přeji pěkný den 😊

---