

Úvodní informace do kurzu Finanční ekonometrie



**SLEZSKÁ
UNIVERZITA**

OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

FIU/NKFEK

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

 - Konzultační hodiny
 - Pondělí 12:00 – 13:30
 - Úterý 12:45 – 13:30 a 14:45 – 15:30
 - Dle předchozí domluvy před a po tutoriálu
 - Jinak dle domluvy
-

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



SLEZSKÁ
UNIVERZITA
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

- Termín odevzdání: nejpozději do **16. 5. 2022**
 - Forma odevzdání – vložení do IS SLU
 - Volba tématu případové studie do **29. 4. 2022**

 - 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
 - písemná praktická zkouška
 - 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.
Σ	100 %	100 b.

Celkové hodnocení

- 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 k jednotlivým tutoriálům – prezentace a videonahrávky v IS SU.**
 - Povinná a doporučená literatura dle sylabu.
-

Organizace výuky



SLEZSKÁ
UNIVERZITA
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

- Veškeré materiály ke studiu předmětu budou průběžně k dispozici v IS SU v interaktivní osnově.
-



**SLEZSKÁ
UNIVERZITA**
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

Děkuji za pozornost a přeji pěkný den 😊
