

# **Seminaria dyplomowe w ZMRF – informacje ogólne**

**Michał Rubaszek**

Zakład Modelowania Rynków Finansowych  
Instytut Ekonometrii

## 1. Zrozumienie materiału omawianego w trakcie studiów:

- a. Metod ilościowych - kierunki MIESI/Big Data
- b. Funkcjonowania rynków finansowych - kierunek FiR
- c. Mechanizmów ekonomicznych - kierunek Ekonomia

## 2. Pracę z literaturą przedmiotu:

- a. Wyszukiwanie właściwych opracowań
- b. Czytanie tekstu ze zrozumieniem

## 3. Umiejętność przygotowania ciekawego raportu nt. uzyskanych wyników:

- a. Logiczna struktura tekstu
- b. Poprawność językowa
- c. Redakcja

## Ocena stopnia spełnienia wymagań merytorycznych pracy dyplomowej

### 1. Dobór tematu pracy i poprawność sformułowania jej celu

[Wartość 5] bardzo dobra

### 2. Oryginalność (nowatorstwo) tematu oraz wartość poznawcza/aplikacyjna pracy dyplomowej

[Wartość 4] dobra

### 3. Sposób rozwiązania postawionego problemu

[Wartość 4] dobra

### 4. Wykorzystanie wiedzy i umiejętności kierunkowych w zakresie związanym z pracą dyplomową

[Wartość 4,5] dobra plus

### 5. Wykorzystanie literatury przedmiotu

[Wartość 4] dobra

## Ocena stopnia spełnienia wymagań formalnych pracy dyplomowej

### 6. Umiejętność konstruowania spójnego, logicznego tekstu

[Wartość 5] bardzo dobra

### 7. Poprawność językowa

[Wartość 4,5] dobra plus

### 8. Redakcja pracy

[Wartość 4,5] dobra plus

1. Umiejętności wykorzystania metod, które nie były omawiane w trakcie studiów
  
2. Umiejętności prowadzenia badań naukowych
  - a. Praca dyplomowa nie jest pracą naukową
  - b. Praca dyplomowa nie musi poszerzać naszego zrozumienia świata

Praca dyplomowa **może** być pracą naukową i wykraczać poza program nauczany w trakcie studiów, ale często prowadzi to ...

... do złożenia pracy po terminie.

**1. W doborze tematu pierwszeństwo mają Państwa pomysły:**

- a. zainteresowania
- b. chęć poszerzenia horyzontów
- c. praca
- d. inne

**2. Możliwość wybrania tematów związanych z działalnością Zakładu:**

- a. analiza dynamiki rynków finansowych
- b. analiza dynamiki rynku surowców
- c. prognozowanie
- d. analiza strategii inwestycyjnych
- e. symulacje makroekonomiczne
- f. inne

- 1. Analiza dynamiki cen wybranego aktywa finansowego**  
metoda: jednowymiarowe modele szeregów czasowych
- 2. Jakość prognozy ex-post dla wybranego aktywa**  
metoda: jednowymiarowe modele szeregów czasowych
- 3. Analiza współzmienności na rynkach finansowych**  
metoda: modele VAR, modele czynnikowe, funkcje łączące
- 4. Analiza dynamiki krzywej dochodowości**  
metoda: model Nelsona-Sieglę, model Diebolda-Li
- 5. Backtesting VaR i ES**  
Metoda: modele klasy GARCH, SV, EWMA
- 6. Strategie inwestycyjne – backtesting**  
Metoda: modele czynnikowe, CAPM, APT
- 7. Ocena ryzyka kredytowego**  
Metoda: modele logitowe, NN, drzewa decyzyjne
- 8. Modelowanie i prognozowanie inflacji / bezrobocia/ PKB**  
Metoda: modele VAR, SVAR, BVAR
- 9. Analiza funkcjonowania rynku najmu**  
Metoda: analiza porównawcza, modele symulacyjne

## Standardowa struktura pracy dyplomowej

Wstęp

Rozdział 1. Opis zjawiska

Rozdział 2. Opis metody badawczej

Rozdział 3. Badanie empiryczne

Podsumowanie

## Optymalna długość pracy:

1. Praca licencjacka: od 25 do 35 stron
2. Praca magisterska: od 30 do 45 stron

**Spotkanie 1:** Informacje na temat pisania pracy

**Spotkanie 2:** Prezentacja planu pracy

- omówienie zakresu tematycznego pracy
- spis treści
- co przynieść: plik .pdf ze spisem treści

**Spotkanie 3:** Przedstawienie wyników empirycznych/prezentacja

- krótka prezentacja (max. 10 min.) na temat uzyskanych wyników

**Następnie:** Złożenie pierwszej wersji pracy do promotora

- **Jak wygląda proces oceny?**

Etap I: Przekazanie pierwszej wersji pracy

Etap II: Informacja zwrotna (komentarze, uwagi)

Etap III: Naniesienie poprawek

Etap IV: Przekazanie drugiej wersji pracy (do systemu)

Etap V: Ocena pracy

- **Na ocenę końcową składają się:**

50% oceny:                      zawartość merytoryczna

50% oceny:                      zawartość formalna

## Od roku akademickiego 2025/2026 student dodatkowo przygotowuje prezentację swojej pracy dyplomowej

- ❑ Student jest zobowiązany wgrać do systemu APD zaaprobowaną przez promotora ostateczną wersję pracy dyplomowej, jak również stanowiący załącznik do pracy plik z prezentacją (oba w formacie pdf)
- ❑ Wymagania formalne dla prezentacji pracy dyplomowej:
  - zgodność z zasadami **identyfikacji wizualnej SGH**,
  - format pliku PDF, **maksymalna objętość 25 MB**,
  - na **pierwszej stronie** powinny znajdować się: tytuł pracy, nazwisko autora, kierunek studiów, nazwisko promotora
- ❑ **Zawartość prezentacji:** cel pracy, metoda badawcza, najważniejsze wnioski i charakterystyka wykorzystanych źródeł

## ▪ **Studia licencjackie**

- Prezentacja → 5 min
- 2 pytania: 1 od promotora (kierunek studiów), 1 od recenzenta (związane z tematem pracy) → 20 min
- **3 oceny cząstkowe**

## ▪ **Studia magisterskie**

- Prezentacja → 10 min
- 3 pytania: 2 przygotowane przez komisję (kierunek studiów), 1 od recenzenta (związane z tematem pracy) → 30 min
- **4 oceny cząstkowe**

1. NIE ZOSTAWIAJ PISANIA PRACY NA OSTATNIĄ MINUTĘ
2. Zapoznaj się z literaturą przedmiotu
3. Przeprowadź badanie / eksperyment
4. Omów uzyskane wyniki z promotorem
5. Stwórz wykresy / tabele oraz opisz uzyskane wyniki
6. Powrót do literatury przedmiotu – przyjrzyj się strukturze tekstów
7. Opisz wyniki empiryczne
8. Opisz część teoretyczną
9. Poproś znajomych / rodzinę o uwagi do tekstu
10. NIE ZOSTAWIAJ PISANIA PRACY NA OSTATNIĄ MINUTĘ

## Literatura:

1. Biblioteka SGH, Biblioteka Narodowa, BUW
2. Web of Knowledge (na terenie SGH lub przez brama.sgh.waw.pl)
3. Ogólnodostępne wyszukiwarki:
  - a. IDEAS
  - b. <http://scholar.google.pl/>
  - c. SSRN

Warto nabyć umiejętność wyszukiwania właściwych artykułów!!!

## Dane:

1. Płatne bazy danych: Eikon Thomson-Reuters: biblioteka SGH
2. Ogólnodostępne bazy: Quandl / Eurostat / OECD / FRED etc.

## Jak cytować opracowania z literatury przedmiotu:

- preferowany jest styl harwardzki, czyli tzw. styl *autor-rok*, aniżeli system oksfordzki, w którym przypisy są podawane za pomocą odnośników (szczegóły na stronie - [link](#))
- przykład z czasopisma Bank i Kredyt ([link](#))
- przykłady z innych czasopism ([link](#))

## Programy do tworzenia bazy danych artykułów:

- JabRef ([link](#)), współpracuje z edytorem LaTeX