

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

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

Złożenie pierwszej 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

Etap V: Ocena pracy

- **Na ocenę końcową składają się:**

50% oceny: zawartość merytoryczna

50% oceny: zawartość formalna

1. NIE ZOSTAWIAJ PISANIA PRACY NA OSTATNIA MINUTE
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. Powróć 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 OSTATNIA MINUTE

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