

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

 - Konzultační hodiny
 - Pondělí 10:30 – 11:00 a 12:30 – 13:40
 - Středa 12:00 – 13:00
 - 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
 - samostatné úkoly na výuce
 - závěrečná zkouška
-

Případová studie

- Termín odevzdání: nejpozději do **16. 5. 2023**
 - Forma odevzdání – vložení do IS SLU
 - Volba tématu případové studie nejpozději do **30. 4. 2023**

 - Náležitosti práce:
 - Úvod (včetně cíle práce)
 - Teoretická část práce (včetně současného stavu poznání, přehled literatury)
 - Empirická část práce (popis dat, stručný popis použitých metod, praktické zpracování a komentáře)
 - Závěr
 - Seznam použitých pramenů a literatury
 - Přílohy
-

Případová studie – témata



**SLEZSKÁ
UNIVERZITA**
OBCHODNĚ PODNIKATELSKÁ
FAKULTA V KARVINĚ

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 | 30 % | 30 b. |
| Samostatné úkoly | 10 % | 10 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 probíraná na přednáškách a seminářích.**
 - 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 😊
