

Program

X Ogólnopolskiego Seminarium Naukowego

Dynamiczne Modele Ekonometryczne

organizowanego w dniach 4-6 września 2007 roku w Toruniu
przez Katedrę Ekonometrii i Statystyki Uniwersytetu Mikołaja Kopernika w Toruniu

3 września 2007 rok (poniedziałek)

15⁰⁰ – 22⁰⁰ – Zakwaterowanie w Domu Studenckim nr 11, ul. Gagarina 33

19⁰⁰ – 21⁰⁰ – Kolacja, Bufet w Domu Studenta nr 9, ul. Gagarina 21 (parter)

4 września 2007 rok (wtorek)

8⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 11)

9⁰⁰ – Otwarcie Seminarium - obrady w gmachu WNEiZ (ul. Gagarina 13a), **sala Rady Wydziału**. Wystąpienia: Dziekana WNEiZ Prof. UMK dr hab. Włodzimierza Karaszewskiego, Prof. dr hab. Zygmunta Zielińskiego i Prof. dr hab. Jerzego W. Wiśniewskiego,

9²⁰ – 11⁴⁵ – Sesja I, Przewodniczący: Prof. dr hab. Krzysztof Jajuga (sala RW)

9²⁰ – 9⁴⁰ – Dr hab. Mariola Piłatowska, prof. UMK (UMK Toruń), *Models Satisfying the Congruence Postulate – overview*,

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Mgr Paweł Kufel, dr hab. Tadeusz Kufel, prof. UMK (UMK Toruń), *The Congruence Postulate the early stage at Dynamic Econometric Models*,

10⁰⁰ – 10¹⁵ – **Przerwa na kawę**

10¹⁵ – 11⁴⁵ – Dr Jennifer Castle, Prof dr David F. Hendry (Oxford University), *Building Congruent Econometric Models using Automatic Econometric Model Selection Tools*

11⁴⁵ – 12⁰⁰ – **Przerwa na kawę**

12⁰⁰ – 13²⁰ – **Sesja II, Przewodniczący: Prof. dr hab. Stanisława Bartosiewicz (sala RW)**

12⁰⁰ – 12²⁰ – Prof. dr hab Krzysztof Jajuga (AE Wrocław), *Ekonometria finansowa – 25 lat później*,

12²⁰ – 12⁴⁰ – Prof. UG, dr hab. Krystyna Strzała, dr Grzegorz Kuczyński (UG), *Czynniki sukcesu akademickiego studentów I roku - zastosowanie metodologii SEM*,

12⁴⁰ – 13⁰⁰ – Prof. dr hab. Grażyna Trzpiot (AE Katowice), *Decomposition of Risk and Quantile Risk Measures*,

13⁰⁰ – 13²⁰ – Prof. UMK, dr hab. Magdalena Osińska, mgr Marcin Fałdziński (UMK), *Modele GARCH i SV z zastosowaniem teorii wartości ekstremalnych*,

13³⁰ – 14⁰⁰ – **Obiad** (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 11)

15⁰⁰ – 16⁰⁰ – **Sesja III A, Przewodniczący: Prof. dr hab. Kazimierz Zajac (sala RW)**

15⁰⁰ – 15²⁰ – Prof. AE, dr hab. Doman Małgorzata (AE Poznań), *Oddziaływanie napływu informacji na dynamikę cen akcji*,

15²⁰ – 15⁴⁰ – Dr Joanna Małgorzata Landmesser (SGGW), *Efekt godziny w dniu na Gieldzie Papierów Wartościowych w Warszawie*,

15⁴⁰ – 16⁰⁰ – Dr Piotr Fiszeder (UMK), Dr Juliusz Preś (PSz), *Wycena opcji pogodowych dla miasta Berlin kwotowanych na giełdzie Chicago Mercantile Exchange*,

15⁰⁰ – 16⁰⁰ – **Sesja III B, Przewodniczący: Prof. dr hab. Mirosław Krzysztofiak (sala IX)**

- 15⁰⁰ – 15²⁰ – Dr Aleksandra Matuszewska, Prof. dr hab. Dorota Witkowska (SGGW), *Kurs euro/dolar natychmiastowy i terminowy – analiza zależności krótkookresowych dla danych obserwowanych z częstotliwością dzienną i tygodniową*,
- 15²⁰ – 15⁴⁰ – Dr Anna Pajor (AE Kraków), *Prognozowanie zdyskontowanej wypłaty europejskiej opcji kupna na indeks WIG20 w modelu ze stochastyczną wariancją i stochastyczną stopą procentową*,
- 15⁴⁰ – 16⁰⁰ – Prof. AM, dr hab Kazimierz Krauze (AM Gdynia), Mgr Anna Krauze (UWM Olsztyn), *Modelowanie notowań otwartych funduszy emerytalnych w Polsce*,

16⁰⁰ – 16²⁰ – **Przerwa na kawę**

16²⁰ – 17²⁰ – **Sesja IV A, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jan Zawadzki (sala RW)**

16²⁰ – 16⁴⁰ – Dr Daniel Papla (AE Wrocław), *Wykorzystanie modelu DCC-MGARCH w analizie zmian zależności wybranych akcji GPW w Warszawie*,

16⁴⁰ – 17⁰⁰ – Dr Ewa Dziawgo (UMK), *Analiza wrażliwości modelu wyceny opcji złożonych*,

17⁰⁰ – 17²⁰ – Dr hab. Ryszard Doman (UAM Poznań), *Modelowanie warunkowych zależności pomiędzy zwrotami finansowymi za pomocą modeli kopuli z przełączaniem typu Markowa*,

16²⁰ – 17²⁰ – **Sesja IVB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Stefan Grzesiak (sala RW)**

16²⁰ – 16⁴⁰ – Dr Barbara Pawełek (AE Kraków), *Normalizacja zmiennych a dopuszczalność prognoz zmiennej syntetycznej*,

16⁴⁰ – 17⁰⁰ – Dr Elżbieta Szulc (UMK), *Modelowanie zależności między przestrzenno-czasowymi procesami ekonomicznymi*,

17⁰⁰ – 17²⁰ – Dr Marek Szajt (PCz), *Techniczne aspekty dekompozycji wyrazu wolnego w modelach przestrzenno-czasowych*,

20⁰⁰ – **Uroczysta kolacja - Pałac Dąbskich, ul. Żeglarska 8,**
(odjazd autobusu sprzed DS 11, o godz. 19.30)

5 września 2007 rok (środa)

8⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 7)

9⁰⁰ – 10⁰⁰ – **Sesja V, Przewodniczący: Prof. Dr hab. Izabela Kudrycka (sala RW)**

9⁰⁰ – 9²⁰ – Mgr Katarzyna Osiecka, (PW), Prof. dr hab. Józef Stawicki (UMK), *Markov Set - Chains jako narzędzie analizy zmian struktury wydatków gospodarstw domowych w Polsce w latach 1993 – 2005*

9²⁰ – 9⁴⁰ – Prof. UG, dr hab. Paweł Miłobędzki (UG), *Orlen czy Lotos? Kto kształtuje ceny na hurtowym rynku benzyn silnikowych w Polsce?*

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Prof. dr hab. Jerzy Witold Wiśniewski (UMK), *Ekonometryczny model miesięcznej płynności finansowej małego przedsiębiorstwa*,

10⁰⁰ – 10²⁰ – **Przerwa na kawę**

10²⁰ – 11⁴⁰ – **Sesja VI A, Przewodniczący: Prof. Dr hab. Paweł Miłobędzki (sala RW)**

10²⁰ – 10⁴⁰ – Dr Mateusz Pipień (AE Kraków), *Wykorzystanie warunkowej asymetrii w badaniu zależności pomiędzy oczekiwaną stopą zwrotu a poziomem ryzyka. Bayesowska analiza dla indeksu WIG*,

10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Dr Jacek Kwiatkowski (UMK), *Modele RCA w bayesowskim modelowaniu i prognozowaniu indeksu WIG20*,

11⁰⁰ – 11²⁰ – Mgr Jakub Bijak (IOM Warszawa), *Bayesowskie prognozowanie migracji zagranicznych w Europie: zastosowanie wybranych propozycji metodologicznych*,

11²⁰ – 11⁴⁰ – Mgr Justyna Wróblewska (AE Kraków), *Bayesowska analiza kointegracji na przykładzie sprzężenia płacowo – cenowego w gospodarce polskiej*,

10²⁰ – 11⁴⁰ – Sesja VI B, Przewodniczący: Prof. Dr hab. Krystyna Strzała (sala IX)

10²⁰ – 10⁴⁰ – Dr Katarzyna Kuziak (AE Wrocław), *Wykorzystanie funkcji powiązań do pomiaru ryzyka rynkowego*,

10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Dr Mirosław Wójciak (AE Katowice), dr Aleksandra Wójcicka (AE Poznań), *Porównanie modyfikacji modelu opcyjnego oceny ryzyka kredytowego*,

11⁰⁰ – 11²⁰ – Dr Daniel Kosiorowski (AE Kraków), *O kwantylowym funkcjonale asymetrii rozkładu wektora losowego w badaniach szeregów finansowych*,

11²⁰ – 11⁴⁰ – Dr Iwona Müller – Frączek (UMK), *Wykorzystanie multiczęstościowego modelu Markowa do opisu zmienności szeregów finansowych*.

11⁴⁰ – 12⁰⁰ – **Przerwa na kawę**

12⁰⁰ – 13²⁰ – Sesja VII A, Przewodniczący: Prof. dr hab. Grażyna Trzpiot, (sala RW)

12⁰⁰ – 12²⁰ – Dr Krzysztof Piontek (AE Wrocław), *Weryfikacja modeli Blacka-Scholesa oraz AR-GARCH dla opcji na WIG20*.

12²⁰ – 12⁴⁰ – Dr Joanna Górka (UMK), *Opis kurtozy rozkładów za pomocą wybranych modeli z funkcją znaku*

12⁴⁰ – 13⁰⁰ – Mgr Justyna Majewska, (AE w Katowicach), *Volatility estimation for Black-Scholes and GARCH models*

13⁰⁰ – 13²⁰ – Mgr Małgorzata Snarska (AE Kraków), *Financial Applications of Random Matrix Theory - dynamics of the Covariance Matrix*

12⁰⁰ – 13²⁰ – Sesja VII B, Przewodniczący: Prof. dr hab. Tadeusz Bolt, (sala IX)

12⁰⁰ – 12²⁰ – Dr Janusz Kowalczyk (UG), *Wykorzystanie zmienności na rynku swapów*,

12²⁰ – 12⁴⁰ – Mgr Dominik Kręzołek (AE Katowice), *Zastosowanie asymetrycznego rozkładu Laplace'a do budowy portfeli inwestycyjnych na polskim rynku kapitałowym*

12⁴⁰ – 13⁰⁰ – Dr Joanna Kisielińska (SGGW), *Modelowanie szeregów czasowych z wahaniami w czasie o nieliniowej zmiennej amplitudzie na przykładzie inflacji rejestrowanej*,

13⁰⁰ – 13²⁰ – Mgr Anna Krauze (UW-M), Prof. AM, dr hab. Kazimierz Krauze, (AM Gdynia), *Analiza efektywności wybranych funduszy inwestycyjnych Pioneer Pekao TFI S.A.*

13³⁰ – 14⁰⁰ – **Obiad** (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 11)

15³⁰ – Wycieczka – Muzeum Piernika, ul. Rabiańska 12, (odjazd autobusu sprzed DS 11, godz. 15:30)

18³⁰ – Tradycyjna polska kolacja – Restauracja "Kuranty", Rynek Staromiejski 24.
Sponsorem kolacji jest firma Timberlake Consultants Ltd., London.

6 września 2007 rok (czwartek)

8⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 7)

9⁰⁰ – 10⁰⁰ – Sesja VIII A, Przewodniczący: Dr hab. Małgorzata Doman (sala RW)

9⁰⁰ – 9²⁰ – Mgr Aneta Włodarczyk, Mgr inż. Marcin Zawada (PCz), *Przelącznikowe modele Markowa dla cen energii elektrycznej na giełdzie energii w Polsce*,

9²⁰ – 9⁴⁰ – Mgr Monika Koško (WSiIE Olsztyn), Dr Michał Pietrzak (UMK), *Wykorzystanie przelącznikowych modeli typu Markowa w modelowaniu zmienności finansowych szeregów czasowych*,

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Dr Alicja Ganczarek (AE Katowice), *Analiza niezależności przekroczeń VaR na wybranym segmencie rynku energii*,

9⁰⁰ – 10⁰⁰ – Sesja VIII B, Przewodniczący: Dr hab. Ryszard Doman (sala IX)

9⁰⁰ – 9²⁰ – Mgr Tomasz Zdanowicz (UMK), *Porównanie własności prognostycznych modeli dwuliniowych i modeli ARMA z błędami GARCH o nieklasycznych rozkładach*

9²⁰ – 9⁴⁰ – Dr Anna Zamojska (UG), *Zastosowanie modelu TAR w analizie nieliniowych szeregów czasowych*

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Dr Marcin Błazejowski (WSB Toruń), *Analiza porównawcza wielorównaniowych modeli mikrorynku produktów konsumpcyjnych estymowanych dla danych tygodniowych i dziennych,*

10⁰⁰ – 10²⁰ – **Przerwa na kawę**

10²⁰ – 11⁴⁰ – Sesja IX A, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jerzy W. Wiśniewski (sala RW)

10²⁰ – 10⁴⁰ – Mgr Małgorzata Borzyskowska (UG), *Analiza empiryczna wybranych zmiennych wchodzących w skład funkcji popytu na pieniądź,*

10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Mgr Karolina Kluth (UMK), *Konwergencja gospodarcza w zakresie kryteriów Traktatu z Maastricht – analiza ekonometryczna,*

11⁰⁰ – 11²⁰ – Mgr Monika Jeziorska-Papka (UMK), *Zastosowanie modeli dwumianowych do opisu asymetrii informacji na rynku ubezpieczeń na przykładzie polis komunikacyjnych OC*

11²⁰ – 11⁴⁰ – Mgr Dominik Śliwicky (UMK), *Estymacja jądrowa w dynamicznych modelach regresji,*

10²⁰ – 11⁴⁰ – Sesja IX B, Przewodniczący: Prof. dr hab. Józef Stawicki (sala IX)

10²⁰ – 10⁴⁰ – Mgr Piotr Szymański (WSG Bydgoszcz), *Analiza portfelowa z wykorzystaniem rozkładów subgaussowskich alfa-stabilnych,*

10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Dr Joanna Muszyńska, Dr Ewa Zdunek (UMK), *Ekonometryczna analiza upadłości przedsiębiorstw w Polsce w latach 1990 – 2005,*

11⁰⁰ – 11²⁰ – Dr Anna Szmit (PŁ), *Analiza czynników wpływających na wielkość bezrobocia w Polsce w porównaniu z wybranymi krajami,*

11²⁰ – 11⁴⁰ – Mgr Emilia Rutkowska, (UMK), *Dynamiczne ujęcie mechanizmu Clarke'a - Grovesa ujawniania preferencji na dobra publiczne,*

11⁴⁰ – 12⁰⁰ – **Przerwa na kawę**

12⁰⁰ – 13²⁰ – Sesja X, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jacek Osiewalski (sala RW)

12⁰⁰ – 12²⁰ – Dr Ewa Kusideł (UŁ), *Zastosowanie modeli VAR i VECM w ewaluacji funduszy unijnych,*

12²⁰ – 12⁴⁰ – Dr Piotr Fiszedler (UMK), *Jak zwiększyć trafność prognoz zmienności, konstruowanych na podstawie modeli GARCH?*

12⁴⁰ – 13⁰⁰ – Dr Witold Orzeszko (UMK), *Wykorzystanie koncepcji nieliniowej przyczynowości do identyfikacji szeregów czasowych*

13⁰⁰ – 13²⁰ – Dr Joanna Bruzda (UMK), *Zależność między produkcją i kapitałem w modelach wzrostu Solowa i Romera. Kointegracja LSTR czy ESTR?*

13²⁰ – Zamknięcie Seminarium – Sala Rady Wydziału, Wystąpienie Prof. dr hab. Zygmunta Zielińskiego

13³⁰ – 14⁰⁰ – **Obiad** (Foyer Aula UMK, ul. Gagarina 11).

Pełne teksty referatów dostępne są na stronie internetowej: <http://www.dem.umk.pl>

W czasie Seminarium codziennie udostępnione będzie laboratorium komputerowe z dostępem do Internetu w godzinach: 8:00 – 9:00, 13:20 – 15:00 oraz w czasie przerw na kawę.