

Program
XII Ogólnopolskiego Seminarium Naukowego
Profesora Zygmunta Zielińskiego
Dynamiczne Modele Ekonometryczne

organizowanego w **dniach 7-9 września 2011** roku w Toruniu
przez Katedrę Ekonometrii i Statystyki Uniwersytetu Mikołaja Kopernika w Toruniu

6 września 2011 rok (wtorek)

- 15⁰⁰ – 22⁰⁰ – Zakwaterowanie w Hotelu Filmar, ul. Grudziądzka 45, <http://www.hotelfilmar.pl>.
Rejestracja uczestników konferencji.
- 19⁰⁰ – Msza Święta w intencji pamięci Profesora Zygmunta Zielińskiego w Kościele Akademickim, Rynek Staromiejski.
- 20⁰⁰ – 22⁰⁰ – Kolacja, Bufet szwedzki, Restauracja Hotel Filmar (2 piętro).

7 września 2011 rok (środa)

- 7⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie - Restauracja hotelowa (2 piętro).
- 8⁴⁵ – Odjazd autobusu sprzed hotelu na Wydział Nauk Ekonomicznych i Zarządzania UMK, ul. Gagarina 13A.
- 9⁰⁰ – **Uroczystość odsłonięcia Tablicy Pamiątkowej ku czci pamięci Prof. Zygmunta Zielińskiego i nadanie Jego imieniem Sali VIII** - Wystąpienia: Prorektora UMK Prof. dr hab. Włodzimierza Karaszewskiego, Dziekana Wydziału Prof. dr hab. Józefa Stawickiego,
- 9¹⁰ – 9²⁰ – **Otwarcie Seminarium** - obrady w **Sali Wykładowej im. Profesora Zygmunta Zielińskiego (Sala VIII)**, wystąpienie: Kierownika Katedry Ekonometrii i Statystyki Prof. dr hab. J.W. Wiśniewskiego.
- 9²⁰ – 10⁰⁰ – **Sesja I, Przewodniczący: Prof. dr hab. Andrzej St. Barczak** (Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach)
- 9²⁰ – 10⁰⁰ – Marcin Błazejowski (WSB Toruń), Paweł Kufel, Tadeusz Kufel (UMK Toruń), *Congruent model*,
- 10⁰⁰ – 10³⁰ – **Przerwa na kawę**
- 10³⁰ – 12⁰⁰ – **Sesja II, Przewodniczący: Prof. dr hab. Krzysztof Jajuga** (UE Wrocław), Sala Rady Wydziału.
- 10³⁰ – 11⁰⁰ – Prof. UEP, dr hab. Małgorzata Doman (UE Poznań), *Wpływ dynamiki kursów walutowych na dynamikę zależności na globalnym rynku akcji*,
- 11⁰⁰ – 11³⁰ – Prof. UG, dr hab. Krystyna Strzała (Uniwersytet Gdański), *Capital Mobility in European Union – another piece in the Feldstein-Horioka puzzle*,
- 11³⁰ – 12⁰⁰ – Prof. dr hab. Dorota Witkowska, dr Krzysztof Kompa, dr Aleksandra Matuszewska-Janica (SGGW), *Analiza relacji pomiędzy rynkami kapitałowymi Europy Środkowej i Wschodniej*,

- 12⁰⁰ – 12¹⁵ – **Przerwa na kawę**
- 12¹⁵ – 13⁴⁵ – **Sesja III, Przewodniczący: Prof. dr hab. Stanisława Bartosiewicz**, Sala Rady Wydziału.
- 12¹⁵ – 12⁴⁵ – Dr Maria Blangiewicz, Prof. UG, dr hab. Paweł Miłobędzki (Uniwersytet Gdański), *Hipoteza oczekiwań struktury terminowej stóp procentowych LIBOR*,
- 12⁴⁵ – 13¹⁵ – Prof. dr hab. Jan B. Gajda (UŁ), *Can dynamic autoregression with autocorrelated errors be estimated consistently?*,
- 13¹⁵ – 13⁴⁵ – Prof. dr hab. Jan Zawadzki (ZUT Szczecin), *Prognozowanie brakujących danych w dziennych szeregach czasowych dla luk systematycznych*,
- 13⁴⁵ – 14⁴⁵ - **Obiad** (Bufet Wydziału, ul. Gagarina 13A).
- 15⁰⁰ – 16⁰⁰ – **Sesja IVA, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jan B. Gajda**, Sala Rady Wydziału.
- 15⁰⁰ – 15²⁰ – Dr Daniel Papla (UE Wrocław), *Analiza zmian zależności między rynkami finansowymi*,
- 15²⁰ – 15⁴⁰ – Prof. UMK, dr hab. Mariola Piłatowska (UMK Toruń), *Kryteria informacyjne i predykcyjne w wyborze modelu prognostycznego*,
- 15⁴⁰ – 16⁰⁰ – Dr Piotr Płuciennik (UAM Poznań), *Transmisja kryzysu zaufania na polski rynek międzybankowy*,
- 15⁰⁰ – 16⁰⁰ – **Sesja IVB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jacek Osiewalski**, Sala VIII – im. Prof. Z. Zielińskiego.
- 15⁰⁰ – 15²⁰ – Dr Katarzyna Bień (SGH), *Order submission strategies – application of the asymmetric ACD model*,
- 15²⁰ – 15⁴⁰ – Dr hab. Piotr Fiszeder (UMK Toruń), *Konstrukcja portfeli o minimalnej wariancji dla dużej liczby spółek. Zastosowanie zmiennych w czasie macierzy kowariancji*,
- 15⁴⁰ – 16⁰⁰ – Dr Grzegorz Szafranski (NBP), *Estimation of dynamic factor models for large data sets*,
- 16⁰⁰ – 16²⁰ – **Przerwa na kawę**
- 16²⁰ – 17²⁰ – **Sesja VA, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jan Zawadzki**, Sala Rady Wydziału.
- 16²⁰ – 16⁴⁰ – Dr Konstancja Paradowska (UE Wrocław), Dr Mirosław Wójciak (UE Katowice), *Zdolności prognostyczne wskaźnika nastroju inwestorów w odniesieniu do zmian indeksu rynku*,
- 16⁴⁰ – 17⁰⁰ – Dr Dorota Górecka, Dr Michał Pietrzak (UMK Toruń), *Modelowanie kursów walutowych dla wybranych krajów skandynawskich, Europy Środkowo-Wschodniej oraz Azji Południowo-Wschodniej*,
- 17⁰⁰ – 17²⁰ – Mgr Anna Michalek (UMK Toruń), *Szacowanie naturalnej stopy procentowej dla Polski w kontekście reguły Taylora*,
- 16²⁰ – 17²⁰ – **Sesja VB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Dorota Witkowska**, Sala VIII – im. Prof. Z. Zielińskiego.
- 16²⁰ – 16⁴⁰ – Dr Justyna Wróblewska (UE Kraków), *Analiza krótkookresowych zależności w modelu VEC – ujęcie bayesowskie*,
- 16⁴⁰ – 17⁰⁰ – Dr Barbara Będowska-Sójka (UE Poznań), *Macroeconomic news effects on the stock market*,

17⁰⁰ – 17²⁰ – Mgr Marcin Fałdziński (UMK Toruń), *Szacowanie wartości zagrożonej przy użyciu metody Self-Exciting POT*,

17³⁰ – Odjazd autobusu sprzed gmachu Wydział do Hotelu Filmar (ul. Grudziądzka 45).

19³⁰ – **Uroczysta kolacja – Sala Kopernikańska, Hotel Filmar, ul. Grudziądzka 45, (2 piętro).**

8 września 2011 rok (czwartek)

7⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie - Restauracja hotelowa (2 piętro).

8⁴⁵ – Odjazd autobusu sprzed hotelu na Wydział Nauk Ekonomicznych i Zarządzania UMK, ul. Gagarina 13A.

9⁰⁰ – 10⁰⁰ – Sesja VIA, Przewodniczący: Prof. UG, dr hab. Paweł Miłobędzki, Sala Rady Wydziału.

9⁰⁰ – 9²⁰ – Prof. UMK, dr hab. Elżbieta Szulc (UMK Toruń), *Identyfikacja struktur procesów przestrzennych i przestrzenno-czasowych wobec problemu agregacji danych*,

9²⁰ – 9⁴⁰ – Dr Milda Maria Burzała (UE Poznań), *Prawdopodobieństwo kryzysu z modeli przelącznikowych i modelu logitowego*,

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Dr Sylwester Bejger (UMK Toruń), *Kartel producentów cementu w Indiach – identyfikacja i ocena*,

9⁰⁰ – 10⁰⁰ - Sesja VIB, Przewodniczący: Prof. UG, dr hab. Krystyna Strzała, Sala VIII – im. Prof. Z.Zielińskiego.

9⁰⁰ – 9²⁰ – Prof. dr hab. Magdalena Osińska, dr Michał Pietrzak, mgr Mirosława Żurek (UMK Toruń), *Identyfikacja noise traders wśród inwestorów indywidualnych na GPW w Warszawie za pomocą modeli równań strukturalnych*.

9²⁰ – 9⁴⁰ – Dr Błażej Mazur (UE Kraków), *Rola warunku stabilności w bayesowskich modelach wektorowej autoregresji*.

9⁴⁰ – 10⁰⁰ – Mgr Karolina Kluth (UMK Toruń), *Konwergencja społeczno-gospodarcza Polski w porównaniu z krajami układu z Schengen w ujęciu panelowym*,

10⁰⁰ – 10²⁰ – Przerwa na kawę

10²⁰ – 11²⁰ - Sesja VIIA, Przewodniczący: Prof. UAM, dr hab. Ryszard Doman, Sala Rady Wydziału.

10²⁰ – 10⁴⁰ – Dr Dominik Śliwiński (WSG Bydgoszcz), *Jądrowy test liniowości*,

10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Dr Maciej Kostrzewa (AGH Kraków), *Bayesowska wycena optymalnej strategii replikującej opcje w modelu JD(M)J*,

11⁰⁰ – 11²⁰ – Dr Dominik Krężolek (UE Katowice), *Nieklasyczne mierniki ryzyka inwestycyjnego na rynku metali nieżelaznych z wykorzystaniem metodologii rozkładów stabilnych*,

10²⁰ – 11²⁰ - Sesja VIIB, Przewodniczący: Prof. UAM, dr hab. Małgorzata Doman, Sala VIII – im. Prof. Z.Zielińskiego.

10²⁰ – 10⁴⁰ – Dr Roman Huptas (UE Kraków), *Modele ACD w analizie danych finansowych UHF: analiza bayesowska*,

- 10⁴⁰ – 11⁰⁰ – Dr Jacek Kwiatkowski (UMK Toruń), *Zmienność parametru kształtu w modelach GARCH o warunkowym rozkładzie t Studenta lub GED*,
- 11⁰⁰ – 11²⁰ – Dr Łukasz Kwiatkowski (UE Kraków), *Bayesowska analiza przełącznikowego efektu in-Mean dla polskiego rynku akcji*,
- 11²⁰ – 11⁴⁰ – Przerwa na kawę**
- 11⁴⁰ – 12⁰⁰ – **Sesja VIIIA, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jerzy W. Wiśniewski**, Sala Rady Wydziału.
- 11⁴⁰ – 12⁰⁰ – Mgr Agnieszka Róg, prof. UG, dr hab. Krystyna Strzała (Uniwersytet Gdański), *Przydatność prognostyczna wskaźników testu koniunktury – wyniki badań empirycznych*,
- 12⁰⁰ – 12²⁰ – Mgr Natalia Drzewoszevska (UMK Toruń), *Transmisja wstrząsów gospodarczych pomiędzy największymi obszarami gospodarki światowej*,
- 12²⁰ – 12⁴⁰ – Mgr Sławomir Mentzen (UMK Toruń), *Wycena opcji za pomocą procesów decyzyjnych Markowa*,
- 11⁴⁰ – 12⁰⁰ – **Sesja VIIIB, Przewodniczący: Prof. UMK, dr hab. Mariola Piłatowska**, Sala Rady Wydziału.
- 11⁴⁰ – 12⁰⁰ – Dr Agata Kliber (UE Poznań), *Środkowoeuropejski rynek instrumentów CDS – analiza powiązań i współzależności*,
- 12⁰⁰ – 12²⁰ – Dr Tomasz Stryjewski (WSliE Olsztyn), *Analiza zachowania przedsiębiorstwa wobec ryzyka rynkowego*,
- 12²⁰ – 12⁴⁰ – Mgr Małgorzata Śniegocka-Łusiewicz (UMK Toruń), *Analiza kalendarzowej zmienności parametrów opisu zawartości koszyka zakupów na przykładzie sklepu obuwniczego*,
- 13⁰⁰ – 14⁰⁰ - **Obiad** (Bufet Wydziału, ul. Gagarina 13A).
- 14⁰⁰ – Odjazd autobusu sprzed gmachu Wydział do Hotelu Filmar (ul. Grudziądzka 45).
- 16⁰⁰ Wycieczka** – zbiórka przed Hotelem Filmar – spotkanie z przewodnikiem, w programie zwiedzanie Starego Miasta, w tym wystawa w Muzeum Okręgowym - Ratuszu Miejskim (Rynek Staromiejski 1) pt. *Pejzaż z miłosiernym Samarytaninem Rembrandta. Skarby Fundacji Książąt Czartoryskich*.
- 19⁰⁰ – Kolacja – Teatr "Baj Pomorski", ul. Piernikarska 9, Spektakl muzyczno-kabaratowy "Alternatywy IV" (<http://imprezy-torun.pl>).**

9 września 2011 rok (piątek)

- 7⁰⁰ – 8⁴⁵ – Śniadanie - Restauracja hotelowa (2 piętro).
- 9⁰⁰ – 10³⁰ – Sesja IX, Przewodniczący: Prof. dr hab. Magdalena Osińska**, Sala Kopernikańska – piętro 2, Hotel Filmar.
- 9⁰⁰ – 9³⁰ – Prof. UAM, dr hab. Ryszard Doman (UAM Poznań), *Szacowanie efektu przenoszenia impulsów z rynku walutowego na polski rynek akcji*,

- 9³⁰ – 10⁰⁰ – Dr Anna Pajor (UE Kraków), *Bayesowski model MSF-BEKK w analizie portfelowej*,
- 10⁰⁰ – 10³⁰ – Mgr Blanka Łęt (UE Poznań), *Zależności przyczynowe pomiędzy wartością dolara amerykańskiego a kursem terminowym ropy naftowej*,
- 10³⁰ – 11⁰⁰ – **Przerwa na kawę**
- 10³⁰ – 11³⁰ - **Sesja X, Przewodniczący: Prof. dr hab. Józef Stawicki**,
Sala Kopernikańska – piętro 2, Hotel Filmar.
- 10³⁰ – 11⁰⁰ – Dr Witold Orzeszko (UMK Toruń), *Nieliniowa analiza opóźnień czasowych w polskich szeregach finansowych*,
- 11⁰⁰ – 11³⁰ – Dr Paweł Kliber (UE Poznań), *Jumps activity and singularity spectra for instruments in Polish stock market*,
- 11³⁰ – 12⁰⁰ – Dr hab. Joanna Bruzda (UMK Toruń), *Falkowe modele funkcji transferowej i ich zastosowania*,
- 12⁰⁰ – **Zamknięcie Seminarium – Sala Kopernikańska (piętro 2)**,
- 12⁰⁰ – 13⁰⁰ **Obiad – Restauracja Hotelu Filmar (piętro 2).**

www.dem.umk.pl

* ** *** ** *

Zaproszenie

**XIII Ogólnopolskie Seminarium Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego,
*Dynamiczne Modele Ekonometryczne, 3-5 września 2013 rok w Toruniu***