

## Program

XI Ogólnopolskiego Seminarium Naukowego Profesora Zygmunta Zielińskiego

# ***Dynamiczne Modele Ekonometryczne***

organizowanego w **dniach 8-10 września 2009** roku w Toruniu  
przez Katedrę Ekonometrii i Statystyki Uniwersytetu Mikołaja Kopernika w Toruniu

### **7 września 2009 rok (poniedziałek)**

15<sup>00</sup> – 22<sup>00</sup> – Zakwaterowanie w Domu Studenckim nr 10, ul. Gagarina 27.

18<sup>30</sup> – 21<sup>00</sup> – Kolacja, Bufet w Domu Studenta nr 10 (piętro 7).

### **8 września 2009 rok (wtorek)**

8<sup>00</sup> – 8<sup>45</sup> – Śniadanie (Bufet - Budynek WNEiZ UMK, ul. Gagarina 13A).

9<sup>00</sup> – **Otwarcie Seminarium** - obrady w gmachu WNEiZ (ul. Gagarina 13a), Sala Rady Wydziału. Przewodniczący: Prof. dr hab. Jerzy W. Wiśniewski, Wystąpienia: Rektora UMK Prof. dr hab. Andrzeja Radziwińskiego, Prorektora UMK Prof. dr hab. Włodzimierza Karaszewskiego, Dziekana WNEiZ Prof. dr hab. Józefa Stawickiego.

9<sup>10</sup> – 10<sup>20</sup> – **Uroczysta Sesja poświęcona pamięci Prof. Zygmunta Zielińskiego, Przewodniczący: Prof. dr hab. Józef Stawicki**, wystąpienia: Prof. dr hab. J.W. Wiśniewski, Dr hab. Mariola Piłatowska, Dr hab. Tadeusz Kufel oraz wystąpienia gości (zgłoszenia przed sesją u prowadzącego).

10<sup>20</sup> – 10<sup>40</sup> – **Przerwa na kawę**

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> – **Sesja I, Przewodniczący: Prof. dr hab. Stanisława Bartosiewicz**, Sala Rady Wydziału.

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> – Prof. dr hab. Krzysztof Jajuga (UE Wrocław), *Kryzys finansowy a ekonometria finansowa*,

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> – Prof. dr hab. Jacek Osiewalski, dr Anna Pajor (UE Kraków), *Bayesian analysis for hybrid MSF-SBEKK models of multivariate volatility*,

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> – Dr hab. Paweł Miłobędzki, prof. UG (UG), *Struktura terminowa stóp procentowych na rynku depozytów międzybankowych w Polsce. Uwagi o symetrii powrotu stóp do średniej*,

11<sup>40</sup> – 12<sup>00</sup> – **Przerwa na kawę**

12<sup>00</sup> – 13<sup>00</sup> – **Sesja II, Przewodniczący: Prof. dr hab. Krzysztof Jajuga**, Sala Rady Wydziału.

12<sup>00</sup> – 12<sup>20</sup> – Prof. dr hab. Stanisława Bartosiewicz (UE Wrocław), *Dydaktyczny aspekt interpretacji wyników wskaźnikowej analizy działalności jednostek gospodarczych*,

12<sup>20</sup> – 12<sup>40</sup> – Dr hab. Krystyna Strzała, prof. UG (UG), *Ekonomiczne uwarunkowania przestępczości - relacja długookresowa*,

12<sup>40</sup> – 13<sup>00</sup> – Prof. dr hab. Jan Gajda (UŁ), *Estymacja dynamicznego równania regresji przy nietypowych resztach*,

13<sup>00</sup> – 14<sup>00</sup> - **Obiad** (Bufet Wydziału, ul. Gagarina 13A).

15<sup>00</sup> – 16<sup>00</sup> – **Sesja IIIA, Przewodniczący: Prof. dr hab. Izabela Kudrycka**, Sala Rady Wydziału.

15<sup>00</sup> – 15<sup>20</sup> – Dr Barbara Będkowska-Sójka (UE Poznań), *CAC40, DAZ and WIG20 returns when the US macro indices are announced*,

- 15<sup>20</sup> – 15<sup>40</sup> – Dr Marcin Zawada, dr Aneta Włodarczyk (Politechnika Częstochowska), *Zastosowanie zmiennych pogodowych w modelowaniu zapotrzebowania na energię elektryczną*,
- 15<sup>40</sup> – 16<sup>00</sup> – Dr Ewa Dziawgo (UMK), *Wycena potęgowej asymetrycznej opcji kupna*,
- 15<sup>00</sup> – 16<sup>00</sup> – **Sesja IIIB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Michał Kolupa**, Sala IX.
- 15<sup>00</sup> – 15<sup>20</sup> – Dr Piotr Fiszeder, Dr Michał Polasik (UMK), *Modelowanie liczby transakcji dokonywanych przy użyciu gotówki i kart płatniczych na rynku polskim*,
- 15<sup>20</sup> – 15<sup>40</sup> – Dr Anna Pajor (UE Kraków), *Bayesowska analiza transformacji Boxa i Coxa dla ilorazu cen w modelach FCSV*,
- 15<sup>40</sup> – 16<sup>00</sup> – Dr Monika Kosko (WSEiI Olsztyn), *Przełącznikowy model typu Markowa (Markov switching) w analizie efektu zarażania na rynkach kapitałowych*,
- 16<sup>00</sup> – 16<sup>20</sup> – **Przerwa na kawę**
- 16<sup>20</sup> – 17<sup>20</sup> – **Sesja IVA, Przewodniczący: Prof. dr hab. Kazimierz Zajac**, Sala Rady Wydziału.
- 16<sup>20</sup> – 16<sup>40</sup> – Dr Milda Maria Burzała (UE Poznań), *Synchronizacja cykli*,
- 16<sup>40</sup> – 17<sup>00</sup> – Dr Witold Orzeszko (UMK), *Współczynnik informacji wzajemnej jako miara zależności nieliniowych w szeregach czasowych*,
- 17<sup>00</sup> – 17<sup>20</sup> – Mgr Roman Huptas (UE Kraków), *Wewnętrzna sezonowość w analizie danych finansowych UHF: modele i ich empiryczna weryfikacja*,
- 16<sup>20</sup> – 17<sup>20</sup> – **Sesja IVB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Mirosław Krzysztofiak**, Sala IX.
- 16<sup>20</sup> – 16<sup>40</sup> – Dr Barbara Dańska-Borsiak (UŁ), *Determinanty TFP według działów przemysłu w Polsce. Dynamiczna analiza panelowa*.
- 16<sup>40</sup> – 17<sup>00</sup> – Dr Iwona Müller-Frączek, Dr Michał Bernard Pietrzak (UMK), *Analiza porównawcza rozwoju ekonomicznego województwa kujawsko-pomorskiego w latach 2003 i 2007 z wykorzystaniem narzędzi statystyki przestrzennej*,
- 17<sup>00</sup> – 17<sup>20</sup> – Dr Marek Szajt (Politechnika Częstochowska), *Szacowanie dysproporcji w aktywności patentowej państw OECD z wykorzystaniem metod przestrzenno-czasowych*.
- 19<sup>30</sup> – **Uroczysta kolacja – Sala Senatu, Collegium Maximum, pl. Rapackiego 1**, (odjazd autobusu sprzed DS 10, o godz. 19.15).

### 9 września 2009 rok (środa)

- 8<sup>00</sup> – 8<sup>45</sup> – Śniadanie (Bufet Wydziału NEiZ, ul. Gagarina 13A).
- 9<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – **Sesja V, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jan Gajda**, Sala Rady Wydziału.
- 9<sup>00</sup> – 9<sup>20</sup> – Dr hab. Ryszard Doman, prof. UAM (UAM Poznań), *Modelowanie dynamiki zależności warunkowych w portfelach wysokowymiarowych*,
- 9<sup>20</sup> – 9<sup>40</sup> – Prof. dr hab. Magdalena Osińska (UMK), *Analiza przyczynowości w długim i krótkim okresie w modelu popytu na pieniądź*,
- 9<sup>40</sup> – 10<sup>00</sup> – Dr hab. Ryszard Kokoszcyński, prof. UW, Dr Natalia Nehrebecka, mgr Paweł Sakowski, dr Paweł Strawiński, dr Robert Ślepaczuk (UW), *Porównanie modeli wyceny opcji na danych wysokiej częstotliwości: Model Blacka-Scholesa z różnymi miarami zmienności*,
- 10<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – Dr hab. Mariola Piłatowska, prof. UMK (UMK), *Prognozy kombinowane z wykorzystaniem wag Akaike'a*.
- 10<sup>20</sup> – 10<sup>40</sup> – **Przerwa na kawę**
- 10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> – **Sesja VIA, Przewodniczący: Dr hab. Paweł Miłobędzki, prof. UG**, Sala Rady Wydziału.
- 10<sup>40</sup> – 11<sup>00</sup> – Dr Daniel Papla (UE Wrocław), *Zastosowanie funkcji powiązań w badaniu „zarażania” rynków*

*finansowych na przykładzie NYSE i GPW w Warszawie.*

- 11<sup>00</sup> – 11<sup>20</sup> – Mgr Ewa Czapla (Politechnika Koszalińska), *Testowanie przyczynowości pomiędzy krótkoterminowymi stopami procentowymi w Polsce, USA i strefie EURO.*
- 11<sup>20</sup> – 11<sup>40</sup> – Mgr Marcin Fałdziński (UMK), *Zastosowanie zmodyfikowanej metody POT z modelami zmienności do oceny ryzyka inwestycji na rynku kapitałowym,*
- 10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> - Sesja VIB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jan Zawadzki, Sala IX.**
- 10<sup>40</sup> – 11<sup>00</sup> – Dr Konstancja Poradowska (UE Wrocław), Dr Mirosław Wójciak (AE Katowice), *Uogólniony rozkład trójkątny w analizie wyników badania foresight,*
- 11<sup>00</sup> – 11<sup>20</sup> – Mgr Jarosław Krajewski (UMK), *Zastosowanie dynamicznego modelu czynnikowego do modelowania i prognozowania PKB w Polsce.*
- 11<sup>20</sup> – 11<sup>40</sup> – Dr Tomasz Stryjewski (WSEiI Olsztyn), Dr Marcin Błażejowski (WSB Toruń), *Symulacyjne wyznaczenie optymalnej wielkości zaburzenia w analizie mnożnikowej,*
- 11<sup>40</sup> – 12<sup>00</sup> – **Przerwa na kawę**
- 12<sup>00</sup> – 13<sup>00</sup> – **Sesja VI, Przewodniczący: Prof. dr hab. Jacek Osiewalski, Sala Rady Wydziału.**
- 12<sup>00</sup> – 12<sup>20</sup> – Dr hab. Małgorzata Doman, prof. UE (UE Poznań), *Modelowanie mikrostruktury rynku akcji,*
- 12<sup>20</sup> – 12<sup>40</sup> – Dr hab. Elżbieta Szulc (UMK), *Modelowanie dynamicznych procesów przestrzennych,*
- 12<sup>40</sup> – 13<sup>00</sup> – Dr Emilia Tomczyk, Dr Barbara Kowalczyk (SGH), *Comparison of Survey Expectations Series with Non-Response and Various Weighting Schemes,*
- 13<sup>00</sup> – 13<sup>20</sup> – Dr Joanna Górka (UMK), *Zastosowanie modeli klasy Sign RCA do wyznaczenia wybranych miar zagrożenia.*
- 13<sup>20</sup> – 14<sup>20</sup> - **Obiad** (Bufet Wydziału, ul. Gagarina 13A).

- 15<sup>00</sup> Wycieczka** – Odjazd autobusu sprzed DS 10 – godz. 15:00, **Centrum Sztuki Współczesnej** (ul. Wały gen. Sikorskiego 13), **Muzeum Podróżników im. Tony Halika** (ul. Franciszkańska 11) oraz **Muzeum Dalekiego Wschodu – Dom pod Gwiazdą** (Rynek Staromiejski 32).
- 19<sup>00</sup> – Kolacja – Restauracja "Gottic", Rynek Staromiejski 1, Sponsorem kolacji jest firma Timberlake Consultants Ltd., London.**

### **10 września 2009 rok (czwartek)**

- 8<sup>00</sup> – 8<sup>45</sup> – Śniadanie (Bufet Wydziału NEiZ, ul. Gagarina 13A).
- 9<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – Sesja VIIIA, Przewodniczący: Dr hab. Ryszard Doman, prof. UAM, Sala Rady Wydziału.**
- 9<sup>00</sup> – 9<sup>20</sup> – Mgr Justyna Wróblewska (UE Kraków), *Prognozowanie w ramach bayesowskich modeli VEC,*
- 9<sup>20</sup> – 9<sup>40</sup> – Dr Jacek Kwiatkowski (UMK), *Prognozowanie inflacji w Polsce przy użyciu modelu Stocka i Watsona,*
- 9<sup>40</sup> – 10<sup>00</sup> – Mgr Błażej Mazur (UE Kraków), *Problemy specyfikacji bayesowskich,*
- 10<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – Dr Dorota Górecka, dr Dominik Śliwicki (UMK), *Modelowanie kursów walutowych dla krajów skandynawskich i Europy Środkowo-Wschodniej.*
- 9<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – Sesja VIIIB, Przewodniczący: Dr hab. Małgorzata Doman, prof. UE, Sala IX.**
- 9<sup>00</sup> – 9<sup>20</sup> – Mgr Anna Michałek (UMK), *Znaczenie szacowania potencjalnego PKB w kontekście weryfikacji reguły Taylora,*
- 9<sup>20</sup> – 9<sup>40</sup> – Dr Ewa Wędrowska (UWM Olsztyn), *Entropia w taksonomii struktur,*
- 9<sup>40</sup> – 10<sup>00</sup> – Mgr Tomasz Zdanowicz (UMK), *Testowanie symetrycznego rozkładu warunkowego koniunkturalnych województw z cyklami ogólnokrajowymi,*

10<sup>00</sup> – 10<sup>20</sup> – Dr Blanka Minc (UE Poznań), *Dynamika wielowymiarowych szeregów czasowych notowań spółek amerykańskiego rynku motoryzacyjnego w warunkach kryzysu.*

10<sup>20</sup> – 10<sup>40</sup> – **Przerwa na kawę**

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> - **Sesja IXA, Przewodniczący: Dr hab. Mateusz Pipień, prof. UEK, Sala Rady Wydziału.**

10<sup>40</sup> – 11<sup>00</sup> – Mgr Kamil Łyko (UE Wrocław), *Skutki błędnej identyfikacji typu niestacjonarności dla modeli kursów akcji spółek z indeksu WIG20,*

11<sup>00</sup> – 11<sup>20</sup> – Dr Sylwester Berger (UMK), *Ekonometryczne narzędzia detekcji równowagi znowy w branży,*

11<sup>20</sup> – 11<sup>40</sup> – Mgr Tomasz Chruściński (UMK), *Badanie współzależności rynków kapitałowych i walutowych z zastosowaniem modeli MGARCH*

11<sup>40</sup> – 12<sup>00</sup> – Dr Anna Rutkowska-Ziarko (UWM Olsztyn), *Wykorzystanie dolnostronnych współczynników beta w analizie ryzyka systematycznego na GPW w Warszawie,*

10<sup>40</sup> – 11<sup>40</sup> - **Sesja IXB, Przewodniczący: Prof. dr hab. Magdalena Osińska, Sala IX.**

10<sup>40</sup> – 11<sup>00</sup> – Mgr Aneta Kłodzińska (Politechnika Koszalińska), *Analiza kointegracji stóp procentowych w Polsce,*

11<sup>00</sup> – 11<sup>20</sup> – Dr Piotr Płuciennik (UAM Poznań), *Prognozowanie procesów finansowych za pomocą modeli dyfuzji,*

11<sup>20</sup> – 11<sup>40</sup> – Mgr Dominik Śliwicki (UMK), *Jądrowe estymatory wariancji warunkowej,*

11<sup>40</sup> – 12<sup>00</sup> – Mgr Marcin Bartkowiak (UE Poznań), *Wycena opcji na indeks WIG20 na podstawie modeli GARCH z przełączeniami reżimów modeli typu wektorowej autoregresji dla danych makroekonomicznych,*

12<sup>00</sup> – 12<sup>20</sup> – **Przerwa na kawę**

12<sup>20</sup> – 13<sup>00</sup> – **Sesja X, Przewodniczący: Dr hab. Krystyna Strzała, prof. UG, Sala Rady Wydziału.**

12<sup>20</sup> – 12<sup>40</sup> – Dr hab. Joanna Bruzda (UMK), *Integracja giełd europejskich i optymalne horyzonty inwestycyjne w świetle analizy falkowej,*

12<sup>40</sup> – 13<sup>00</sup> – Dr Marcin Błażejowski, Mgr Paweł Kufel, Dr hab. Tadeusz Kufel (UMK), *Automatyczna procedura budowy specyfikacji zgodnego dynamicznego modelu ekonometrycznego w oprogramowaniu GRETL.*

13<sup>00</sup> – **Zamknięcie Seminarium – Sala Rady Wydziału,**

13<sup>10</sup> – 14<sup>00</sup> **Obiad (Bufet Wydziału, ul. Gagarina 13A).**

[www.dem.umk.pl](http://www.dem.umk.pl)

\* \*\* \*\*\* \*\* \*

**Zapraszamy na XII Ogólnopolskie Seminarium Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego,  
Dynamiczne Modele Ekonometryczne, 6-8 września 2011 rok w Toruniu**