

# KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

## Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	EKONOMETRIA FINANSOWA	
AG/O/II/ST/B1.17			FINANCIAL ECONOMETRICS	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2023/2024		
Kierunek		Analityka Gospodarcza		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki,		
Forma studiów		studia stacjonarne		
Semestr / semestry		3		
Przynależność do grupy zajęć		Grupa zajęć kierunkowych obowiązkowych		
Status przedmiotu		Obowiązkowy		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	15 [h]	3 ECTS
		Ćwiczenia	15 [h]	
		Konwersatorium	[h]	
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse		2 ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i Finanse		3 ECTS
Forma nauczania		tradycyjna- zajęcia zorganizowane w Uczelni / zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość		
Wymagania wstępne		Wszyscy studenci kierunku Analityka Gospodarcza		
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
Koordynator		Prof. Sławomir I. Bukowski		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail, telefon koordynatora		s.bukowski@uthrad.pl (48) 361-74-96		

**EFEKTY UCZENIA SIĘ, TREŚCI PROGRAMOWE, REALIZACJA ZAJĘĆ DYDAKTYCZNYCH, WERYFIKACJA EFEKTÓW UCZENIA SIĘ**

Cel kształcenia:	Celem zajęć z przedmiotu jest zapoznanie studentów z metodami ekonometrii finansowej, ukształtowanie nowych umiejętności w zakresie modelowania procesów finansowych i ich analizy ekonometrycznej.
Treści programowe:	<p>Treści zajęć są powiązane z prowadzonymi badaniami naukowymi.</p> <p><b>Treści - Wykład:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Charakterystyka finansowych szeregów czasowych (2h, W1)</li> <li>Stacjonarność i niestacjonarność finansowych szeregów czasowych (2h, W1)</li> <li>Kointegracja szeregów czasowych. Badanie kointegracji. Przykłady (2h, W1)</li> <li>Modele VAR i SVAR i ich zastosowanie. Przykłady (2h, W1)</li> <li>Modele VECM i ich zastosowanie. Przykłady (2h, W1)</li> <li>Modele ARCH, GARCH i ich zastosowanie. Przykłady (2h, W1)</li> <li>Modele danych panelowych i ich zastosowanie. Przykłady (3h, W1)</li> </ul> <p><b>Treści ćwiczeń:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Modelowanie finansowych szeregów czasowych z zastosowaniem VAR, VECM, Arch, Garch, modeli panelowych z użyciem oprogramowania GRETL i MATLAB (15h, BN, U1, K1)</li> </ul>
Metody dydaktyczne (kształcenia):	Wykład i ćwiczenia praktyczne w laboratorium komputerowym z wykorzystaniem programu GRETL oraz wybranych elementów oprogramowania MATLAB
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p><i>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</i></p> <p>Zaliczenie wykładu na podstawie projektu</p> <p>Zaliczenie ćwiczeń na podstawie projektu - modelowanie ekonometryczne wybranych zjawisk finansowych</p>

Efekty uczenia się dla przedmiotu w odniesieniu do efektów kierunkowych i formy zajęć				Metody weryfikacji efektów uczenia się	
Numer efektu uczenia się	Opis efektów uczenia się dla przedmiotu (PEU) Student, który zaliczył przedmiot (W) zna i rozumie/ (U) potrafi /(K) jest gotów do:	Kierunkowy efekt uczenia się (KEU)	Forma zajęć	Forma weryfikacji (zaliczeń)	Metody sprawdzania i oceny
W1	Zna i rozumie w pogłębionym stopniu wybrane zagadnienia ekonometrii finansowej, w tym wybrane metody szacowania finansowych szeregów czasowych	K_W05	Wykład	Zaliczenie na ocenę	Na podstawie poprawności projektu
U1	Potrafi analizować procesy i zjawiska społeczne wykorzystując w tym celu standardowe metody i narzędzia z obszaru ekonometrii finansowej oraz wyszukać dane niezbędne do przeprowadzenia danej analizy	K_U02 K_U05	ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Na podstawie poprawności projektu
K1	Jest gotów do krytycznej oceny posiadanej wiedzy z zakresu ekonometrii finansowej oraz formułowania wniosków na podstawie wyników przeprowadzanych przez siebie analiz	K_K01	ćwiczenia	Zaliczenie na ocenę	Na podstawie poprawności projektu

Literatura i pomoce naukowe
1. Osińska M. (2006) <i>Ekonometria finansowa</i> , Warszawa, PWE
2. Fiszeder P. (2009), <i>Modele klasy GARCH w empirycznych badaniach finansowych</i> , Wydawnictwo naukowe UMK, Toruń.
3. Kusideł E.(2000), <i>Modele wektorowo-autoregresyjne VAR. Metodologia i zastosowania</i> , Absolwent, Olsztyn.
4. Dańska-Borsak B. (2011), <i>Dynamiczne modele panelowe w badaniach ekonomicznych</i> , Wydawnictwo Uniwersytetu Łódzkiego, Łódź.
5. Gruszczyński M., Witkowski B., Wiśniowski A., Szulc A., Owczarczuk A., Książek M., Bazyl M. (2012) <i>Mikroekonometria. Modele i metody analizy danych indywidualnych</i> , Wolter Kluwer, Warszawa.
6. Doman M., Doman R. (2009) <i>Modelowanie zmienności i ryzyka. Metody ekonometrii finansowej</i> . Oficyna Wolters Kluwer, Kraków.
7. Kufel T. (2011), <i>Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu GRETL</i> , Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
8. Enders W. (1995) <i>Applied Econometric Time Series</i> . Wiley.
9. Maddala G.S.(2006) <i>Ekonometria</i> , PWN, Warszawa
10. Oprogramowanie GRETL
11. Oprogramowanie MATLAB
12. Ł. Zięba, <i>Some Selected Determinants of Stock Exchange Development: Evidence from Greece</i> , <i>European Research Studies Journal</i> , Volume XXIV, Special Issue 4, 260-268, 2021. ISSN: 1108-2976. DOI: 10.35808/ersj/2687
13. Ł. Zięba, <i>Stock Exchange Development in V4 Countries</i> , <i>European Research Studies Journal</i> , Volume XXIV, Special Issue 4, 300-307, 2021. ISSN: 1108-2976. DOI: 10.35808/ersj/2691
14. Ł. Zięba, <i>Development of stock markets in selected countries in the 21st century</i> , w S.I. Bukowski, A. Hyż, M.B. Lament (red.), <i>Competitiveness and economic development in Europe. Prospects and challenges</i> , ISBN 978-0-367-55830-7, Routledge 2021, pp. 59-69 (100%)
Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podaje prowadzący

Nakład pracy studenta potrzebny do osiągnięcia zakładanych efektów uczenia się – bilans punktów ECTS			
Udział w zajęciach, aktywność	Obciążenie studenta [h]		
	Inne godz. kontaktowe (IGK)	Zajęcia bez nauczyciela-praca własna studenta (ZBN)	Zajęcia dydaktyczne
Udział w wykładach/konwersatoriach	X	X	15 [h]
Udział w ćwiczeniach/laboratorium	X	X	15 [h]
Udział w konsultacjach	5 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwiczeń/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	40 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	40 [h]/ 1,6 ECTS	30 [h]/ 1,2 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	3 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
W przypadku studentów ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych, określone powyżej (w karcie) metody i formy weryfikacji efektów uczenia się dostosowuje się odpowiednio do indywidualnych potrzeb tych studentów. Szczegółowe zasady i formy wsparcia studentów ze szczególnymi potrzebami: w tym z niepełnosprawnością, przewlekle chorych podczas zajęć, zaliczeń i egzaminów określono w: Regulaminie Studiów, Zasadach Studiowania, Procedurze dotyczącej zapewnienia dostępności procesu kształcenia studentom ze szczególnymi potrzebami, w tym: z niepełnosprawnością, przewlekle chorych.