

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	EKONOMETRIA FINANSOWA	
AG/O/II/NST/B1.17			FINANCIAL ECONOMETRICS	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2024/2025		
Kierunek		Analityka Gospodarcza		
w zakresie		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki,		
Forma studiów		studia niestacjonarne		
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	8 [h]	3 ECTS
		Ćwiczenia/Warsztaty	[h]	
		Konwersatorium	[h]	
		Laboratorium	10 [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		
Wymagania wstępne		Zaliczony przez studenta przedmiot A1 – Ekonometria II		
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
Koordynator		Prof. Sławomir I. Bukowski		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail koordynatora		s.bukowski@urad.edu.pl		

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>Treści - Wykład:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Charakterystyka finansowych szeregów czasowych • Stacjonarność i niestacjonarność finansowych szeregów czasowych • Kointegracja szeregów czasowych. • Modele VAR i SVAR i ich zastosowanie. • Modele VECM i ich zastosowanie. • Modele ARCH, GARCH i ich zastosowanie. • Modele danych panelowych i ich zastosowanie. <p>Treści - laboratorium:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Modelowanie finansowych szeregów czasowych z zastosowaniem VAR, VECM, Arch, Garch, modeli panelowych z użyciem oprogramowania GRET i MATLAB
Metody dydaktyczne (kształcenia):	Wykład i ćwiczenia praktyczne w laboratorium komputerowym z wykorzystaniem programu GRET i oraz wybranych elementów oprogramowania MATLAB
Rygor zaliczenia, kryteria oceny osiągniętych efektów uczenia się, sposób obliczania oceny końcowej:	<p>Warunkiem zaliczenia przedmiotu jest osiągnięcie wszystkich wymaganych efektów uczenia się określonych dla przedmiotu.</p> <p>Wykład – zaliczenie bez oceny, (zal); warunkiem uzyskania zaliczenia jest pozytywne zaliczenie laboratorium</p> <p>Laboratorium - Zaliczenie 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 wybrane zagadnienia ekonometrii finansowej, w tym wybrane metody szacowania finansowych szeregów czasowych	K_W05	Wykład Laboratorium	W - Zaliczenie bez oceny, L – zaliczenie na ocenę	W - Pozytywna ocena z laboratorium, L - projekt
U1	Potrafi analizować procesy i zjawiska społeczne wykorzystując w tym celu standardowe metody i narzędzia z obszaru ekonometrii finansowej	K_U02	Laboratorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt
U2	Potrafi wyszukać dane niezbędne do przeprowadzenia danej analizy	K_U05	Laboratorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt

K1	Jest gotów do krytycznej oceny posiadanej wiedzy z zakresu ekonometrii finansowej oraz formułowania wniosków na podstawie wyników przeprowadzanych przez siebie analiz	K_K01	Laboratorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt
----	--	-------	--------------	---------------------	---------

Literatura i pomoce naukowe	
Literatura podstawowa	
1. Welfe A., 2023, Ekonometria, Warszawa, PWE	
2. Bernardelli M., Decewicz A., Tomczyk E., 2021, Ekonometria i badania operacyjne. Zbiór zadań, Warszawa, Wydawnictwo Naukowe PWN	
3. Oprogramowanie GRET, MATLAB	
Literatura uzupełniająca	
1. Enders W., 2023, Applied Econometric Time Series, 4th Edition (ebook), Wiley	
2. Adkins L. C., 2018, Using gretl for Principles of Econometrics, 5th Edition Version 1.01, Publikacja online – wolny dostęp, https://www.learneconometrics.com/gretl/poe5/using_gretl_for_POE5.pdf	
3. Osińska M. (2006) Ekonometria finansowa, Warszawa, PWE	
4. Zięba Ł., 2021, Some Selected Determinants of Stock Exchange Development: Evidence from Greece, European Research Studies Journal, Volume XXIV, Special Issue 4, 260-268, 2021. ISSN: 1108-2976. DOI: 10.35808/ersj/2687	
5. Zięba Ł., 2021, Stock Exchange Development in V4 Countries, European Research Studies Journal, Volume XXIV, Special Issue 4, 300-307, 2021. ISSN: 1108-2976. DOI: 10.35808/ersj/2691	
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	8 [h]
Udział w ćwiczeniach/warsztatach/laboratorium	X	X	10 [h]
Udział w konsultacjach	5 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab Przygotowanie do zaliczenia/egzaminu	X	52 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	5 [h]/ 0,2 ECTS	52 [h]/ 2,1 ECTS	18 [h]/ 0,7 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	75 [h] / 3 ECTS		

Informacje dodatkowe, uwagi
<p>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.</p> <p>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.</p>