

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	EKONOMETRIA FINANSOWA	
AG/O/II/ST/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 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/Warsztaty	[h]	
		Konwersatorium	[h]	
		Laboratorium	15 [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	K_K01	Laboratorium	Zaliczenie na ocenę	Projekt

	wyników przeprowadzanych przez siebie analiz				
--	--	--	--	--	--

Literatura i pomoce naukowe
<p>Literatura podstawowa</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 <p>Literatura uzupełniająca</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 <p>Szczegółowy wykaz dodatkowych źródeł i pomocy naukowych na pierwszych zajęciach podaje prowadzący</p>

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/warsztatach/laboratorium	X	X	15 [h]
Udział w konsultacjach	5 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/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	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>