

KARTA PRZEDMIOTU (SYLABUS)

Opis przedmiotu

Kod przedmiotu		Nazwa przedmiotu	EKONOMETRIA FINANSOWA	
FiR/O/II/ST/A.1			FINANCIAL ECONOMETRICS	
Język wykładowy		Polski		
Rok akademicki		2025/2026		
Kierunek w zakresie		Finanse i Rachunkowość		
		-		
Poziom studiów		studia drugiego stopnia		
Profil studiów		ogólnoakademicki		
Forma studiów		studia stacjonarne		
Semestr / semestry		2		
Przynależność do grupy zajęć		A. Grupa zajęć podstawowych		
Status przedmiotu		Obowiązkowy		
Formy realizacji zajęć dydaktycznych, wymiar, punkty ECTS		Forma zajęć	Liczba godzin zajęć dydaktycznych	Liczba punktów ECTS
		Wykład	15 [h]	4 ECTS
		Laboratorium	30 [h]	
		Konwersatorium	[h]	
Powiązanie przedmiotu	z profilem studiów	Związany z prowadzoną działalnością naukową w dyscyplinie ekonomia i finanse		ECTS
	z uprawnieniami	-----		ECTS
	z dyscypliną	Ekonomia i finanse		4 ECTS
Forma nauczania		Tradycyjna - zajęcia zorganizowane w Uczelni		
Wymagania wstępne		Znajomość elementarnej algebry liniowej, podstaw statystyki oraz modelowania ekonometrycznego		
Jednostka prowadząca		Katedra Biznesu i Finansów Międzynarodowych		
Koordynator		Dr Zbigniew Śleszyński		
Adres strony internetowej pjo		http://weif.uniwersytetradom.pl		
Adres e-mail koordynatora		z.sleszynski@urad.edu.pl		

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

Cel kształcenia:	Celem zajęć z przedmiotu jest uzyskanie wiedzy o zaawansowanych metodach ilościowych stosowanych w modelowaniu ekonometrycznym oraz w prognozowaniu finansowych szeregów czasowych i danych panelowych
Treści programowe:	<p>Treści zajęć są powiązane z prowadzonymi badaniami naukowymi.</p> <p>Treść wykładów:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Uwagi ogólne na temat modelowania ekonometrycznego, klasyfikacji modeli, rodzaje danych • Charakterystyka ekonometrii finansowej, • Charakterystyka finansowych szeregów czasowych • Modele jednowymiarowych szeregów czasowych (stacjonarność i niestacjonarność, procedura Boxa – Jenkinsa, ARIMA), • Kointegracja szeregów czasowych, • Modele wielorównaniowe, • 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>Treść laboratorium:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Modelowanie finansowych szeregów czasowych w oparciu o dane rzeczywiste z zastosowaniem VAR, VECM, Arch, Garch, modeli panelowych z użyciem oprogramowania GRET, Excel, zajęcia w sali komputerowej • Przygotowanie własnego projektu badawczego, modelu ekonometrycznego przez studenta.,
Metody dydaktyczne (kształcenia):	Wykład i ćwiczenia praktyczne w laboratorium komputerowym z wykorzystaniem programu GRET i arkusza kalkulacyjnego obserwacja
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>Na ocenę końcową z przedmiotu składają się:</p> <p>1) ocena z laboratorium – na którą składają się:</p> <p>----projekt (opracowanie własnego modelu ekonometrycznego, jego weryfikacja – 40 pkt. (próg zaliczenia projektu 20 pkt.)</p> <p>----poziom osiągnięcia kompetencji społecznych – 10 pkt</p> <p>łącznie z laboratorium student może uzyskać 50 pkt. Ocena z laboratorium zostanie wystawiona zgodnie z zasadą:</p> <p>25 pkt. i mniej – niedostateczny (2)</p> <p>(25-30] pkt – dostateczny (3)</p> <p>(30-35] pkt – dostateczny plus (3,5)</p> <p>(35-40] pkt – dobry (4)</p> <p>(40-45] pkt – dobry plus (4,5)</p> <p>(45-50] pkt – bardzo dobry (5)</p> <p>2) ocena z wykładu – zaliczenie bez oceny (zał), zaliczenie mogą uzyskać wyłącznie studenci, którzy uzyskają zaliczenie z pozostałych form zajęć;</p> <p>Ocena stopnia osiągnięcia wymaganych kompetencji społecznych jest wynikiem oceny przeprowadzanej przez prowadzącego zajęcia na podstawie:</p>

	<ul style="list-style-type: none"> - oceny aktywności studenta na zajęciach, - oceny na podstawie obserwacji bezpośredniej elementów: komunikacja, współpraca, rozwiązywanie problemów.
--	---

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 ekonometrycznej	K_U04	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	Obserwacja Aktywność na zajęciach

Literatura i pomoce naukowe	
Literatura podstawowa: <ul style="list-style-type: none"> • Górecki B. R., Ekonometria podstawy teorii i praktyki, Wydawca Key Text (7 kwietnia 2021) • Kufel T., Ekonometria, rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu Gretl, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa, wydanie 3, 2024, • Program GRETL Literatura uzupełniająca: <ul style="list-style-type: none"> • Maddala G., Ekonometria, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2006 (dodruk 2024). • Osińska M. (2006) Ekonometria finansowa, Warszawa, PWE • Welfe A., 2023, Ekonometria, Warszawa, PWE 	
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	30 [h]
Udział w konsultacjach	2 [h]	X	X
Przygotowanie do wykładów/ćwicz/lab - 23[h] Przygotowanie projektu – 30[h]	X	53 [h]	X
Sumaryczne obciążenie pracą studenta	2 [h] / 0,1 ECTS	53 [h] / 2,1 ECTS	45[h] / 1,8 ECTS
Punkty ECTS za przedmiot	100 [h] / 4 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>