

Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	Ekonometria w finansach, PG_00154891						
Kierunek studiów	Finanse i rachunkowość (O)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2024 r.		Rok akademicki realizacji przedmiotu		2026/2027		
Poziom kształcenia	I stopnia - licencjackie		Grupa zajęć		Grupa zajęć obowiązkowych z zakresu kierunku studiów Grupa zajęć powiązanych z prowadzonymi badaniami naukowymi w dziedzinie nauki związanej z kierunkiem - profil ogólnoakademicki		
Forma studiów	niestacjonarne		Sposób realizacji		na uczelni		
Rok studiów	3		Język wykładowy		polski		
Semestr studiów	5		Liczba punktów ECTS		3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki		Forma zaliczenia		zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydział Zarządzania -> Katedra Ekonometrii						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot		dr Sabina Nowak				
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	20.0	20.0	0.0	0.0	0.0	40
	W tym liczba godzin zajęć na odległość: 0.0						
Aktywność studenta i liczba godzin pracy	Aktywność studenta	Udział w zajęciach dydaktycznych, objętych planem studiów		Udział w konsultacjach		Praca własna studenta	RAZEM
	Liczba godzin pracy studenta	40		25.0		10.0	75
Cel przedmiotu	Ukazanie modelu ekonometrycznego jako narzędzia pomiaru w finansach oraz wyrobienie świadomości ograniczeń jego stosowania.						

Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy	Efekt z przedmiotu	Sposób weryfikacji i oceny efektu
	[FiRL3_K02] Współpraca: - potrafi harmonijnie współdziałać i pracować w grupie, przyjmując w niej różne role - potrafi uzgodnić z grupą cele i podział zadań - jest otwarty, szanuje odmienność innych członków zespołu.	Potrafi pracować w grupie nad zagadnieniami z zakresu analizy rynku finansowego i finansów przedsiębiorstw.	[SK2] prezentacja/projekt/referat/raport [SK5] realizacja zadania problemowego [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRL3_K01] Samodoskonalenie: - rozumie potrzebę rozwoju i uczenia się przez całe życie - potrafi uzupełniać i doskonalić nabytą wiedzę i umiejętności - zna swoje silne i słabe strony, stawia sobie ambitne cele na miarę swoich możliwości - umie przyjąć porażkę, przyznać się do błędu.	Student rozumie potrzebę uzupełniania wiedzy o modelowaniu w finansach, jest otwarty na poznawanie nowoczesnych metod stosowanych w analizie rynków finansowych i finansach przedsiębiorstw.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/dyskusja [SK8] obserwacja samodzielnej lub zespołowej pracy studenta
	[FiRL3_U04] Potrafi prognozować procesy i zjawiska ekonomiczne w zakresie finansów i rachunkowości z wykorzystaniem zaawansowanych metod i narzędzi.	Potrafi prognozować zjawiska związane z rynkiem finansowym i finansami przedsiębiorstw na podstawie samodzielnie wyspecyfikowanych i oszacowanych modeli ekonometrycznych.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/raport [SU3] opracowanie tekstowe/praca pisemna [SU4] test/egzamin - ustny lub pisemny
	[FiRL3_W02] Ma zaawansowaną wiedzę o różnych rodzajach struktur i instytucji ekonomicznych oraz zmianach w nich zachodzących, w szczególności o: systemie bankowym, ubezpieczeniowym, podatkowym, rynkach finansowych, organizacji systemu finansów publicznych oraz sektora prywatnego. Zna wzajemne relacje pomiędzy tymi strukturami i instytucjami społecznymi w skali krajowej i międzynarodowej.	Ma zaawansowaną wiedzę o modelowaniu na podstawie danych finansowych o różnych częstotliwościach.	[SW4] test/egzamin - ustny lub pisemny [SW2] prezentacja/projekt/referat/raport [SW3] opracowanie tekstowe/praca pisemna
	[FiRL3_K03] Komunikacja: - potrafi w sposób zrozumiały dla innych przedstawić swój pogląd, zagadnienie - odważnie (ale z rozwagą) wyraża swoje zdanie, nie boi się zadawać pytań - potrafi kulturalnie uczestniczyć w dyskusji - umie wyrażać konstruktywną krytykę.	Potrafi dyskutować na tematy związane z analizą danych finansowych, analizą ilościową stosowaną w finansach przedsiębiorstw i modelowaniem rynku finansowego.	[SK1] wypowiedź ustna/rozmowa/dyskusja [SK2] prezentacja/projekt/referat/raport
	[FiRL3_U02] Potrafi pozyskiwać z różnych źródeł dane do analizowania konkretnych procesów i zjawisk ekonomicznych dotyczących finansów. Potrafi korzystać z technologii informacyjnych.	Potrafi pozyskiwać dane finansowe o różnych częstotliwościach z różnych źródeł i baz danych.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/raport [SU3] opracowanie tekstowe/praca pisemna [SU5] realizacja zadania problemowego
	[FiRL3_W06] Zna zaawansowane metody i narzędzia, w tym techniki pozyskiwania i analizy danych, właściwe dla nauki o zarządzaniu i jakości, pozwalające opisywać struktury i instytucje ekonomiczne oraz procesy w nich i między nimi zachodzące.	Potrafi pozyskiwać i analizować dane finansowe pozwalające na opisywanie prawidłowości zachodzących na rynku finansowym i wykorzystywane w badaniach finansów przedsiębiorstw.	[SW2] prezentacja/projekt/referat/raport [SW5] realizacja zadania problemowego
	[FiRL3_U03] Potrafi właściwie analizować przyczyny, przebieg i skutki konkretnych procesów i zjawisk w zakresie finansów i rachunkowości, z wykorzystaniem zaawansowanych teorii i właściwych metod nauk społecznych. Potrafi zidentyfikować interesariuszy procesów i zjawisk w dyscyplin: nauki o zarządzaniu i jakości oraz ekonomia i finanse.	Potrafi zidentyfikować prawidłowości zachodzące na rynkach finansowych i w finansach przedsiębiorstw z wykorzystaniem metod modelowania ekonometrycznego.	[SU2] prezentacja/projekt/referat/raport [SU3] opracowanie tekstowe/praca pisemna [SU5] realizacja zadania problemowego

Treści przedmiotu	<div>1. Ekonometria w naukach ekonomicznych. Finansowe szeregi czasowe. Rodzaje i przykłady danych.</div> <div>2. Model regresji liniowej. Przykłady modeli ekonometrycznych.</div> <div>3. Klasyczna Metoda Najmniejszych Kwadratów (MNK). Estymator i jego własności. Zastosowanie estymatora do szacowania parametrów strukturalnych modelu. Założenia stochastyczne.</div> <div>4. Weryfikacja modelu I. Ocena dobroci dopasowania modelu.</div> <div>5. Weryfikacja modelu II. Badanie istotności parametrów strukturalnych. Przedziały ufności.</div> <div>6. Weryfikacja modelu III. Testowanie założeń stochastycznych. Stałość wariancji składników losowych, brak autokorelacji i normalność rozkładu. Ocena poprawności postaci funkcyjnej modelu.</div> <div>7. Wyznaczanie prognoz na podstawie modeli ekonometrycznych. Dokładność prognozowania.</div> <div>8. Modele dynamiczne. Mnożniki: obliczenia i interpretacja. Przykłady modeli dynamicznych.</div> <div>9. Wykorzystanie zmiennych zerojedynkowych w modelowaniu zjawisk jakościowych i cyklicznych.</div> <div>10. Własności finansowych szeregów czasowych. Badanie stacjonarności.</div> <div>11. Modelowanie i prognozowanie z wykorzystaniem procesów autoregresyjnych (ARMA, ARIMA).</div> <div>12. Modele wyceny (Sharpe'a, CAPM).</div> <div>13. Zastosowanie modelowania w finansach przedsiębiorstw.</div>		
Wymagania wstępne i dodatkowe	Studenci winni znać zasady zachowań rynkowych konsumenta i producenta, podstawowe modele konkurencji rynkowej, równowagi i wzrostu gospodarczego, handlu międzynarodowego, rynku kapitałowego i pieniężnego. Powinni posiadać elementarną wiedzę z zakresu statystyki oraz praktyczną umiejętność eksploracji danych.		
Sposoby i kryteria oceniania osiągniętych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Zaliczenie: na podstawie (i) pisemnego kolokwium z zadań, (ii) pisemnego projektu oraz jego prezentacji, (iii) aktywności na zajęciach.	51.0%	100.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	<div>1. T. Kufel, Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu Gretl. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2004.</div> <div>2. G. Koop, Wprowadzenie do ekonometrii. Oficyna Wolters Kluwer, Warszawa 2011.</div> <div>3. M. Gruszczyński M. Podgórska, T. Kuszewski, Ekonometria i badania operacyjne. Podręcznik dla studiów licencjackich. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2022.</div>	
	Uzupełniająca lista lektur	<div>1. R. Ramanathan, Introductory Econometrics with Applications. South-Western, Mason 2002.</div> <div>2. M. Osińska, Ekonometria finansowa. Wydawnictwo PWE, Warszawa 2005.</div> <div>3. L.C. Adkins, Using <i>gretl</i> for Principles of Econometrics, 5th Edition, Version 1.0, 2018.</div>	
	Adresy eZasobów	Uzupełniające Adresy na platformie eNauczanie:	
Przykładowe zagadnienia/ przykładowe pytania/ realizowane zadania			
Praktyki zawodowe w ramach przedmiotu	Nie dotyczy		

Dokument wygenerowany elektronicznie. Nie wymaga pieczęci ani podpisu.