*Załącznik nr 1.5 do Zarządzenia Rektora UR nr 12/2019*

**SYLABUS**

**dotyczy cyklu kształcenia****2022-2024**

Rok akademicki 2023/2024

1. Podstawowe informacje o przedmiocie

|  |  |
| --- | --- |
| Nazwa przedmiotu | Metody ilościowe w finansach |
| Kod przedmiotu\* | FiR/II/RiA/C-1.1a |
| Nazwa jednostki prowadzącej kierunek | Kolegium Nauk Społecznych |
| Nazwa jednostki realizującej przedmiot | Instytut Ekonomii i Finansów KNS |
| Kierunek studiów | Finanse i Rachunkowość |
| Poziom studiów | Drugi |
| Profil | Ogólnoakademicki |
| Forma studiów | Stacjonarne |
| Rok i semestr/y studiów | II / 3 |
| Rodzaj przedmiotu | Specjalnościowy do wyboru |
| Język wykładowy | Polski |
| Koordynator | dr inż. Jolanta Wojnar |
| Imię i nazwisko osoby prowadzącej / osób prowadzących | dr inż. Jolanta Wojnar |

\* *opcjonalni*e, *zgodnie z ustaleniami w Jednostce*

1.1.Formy zajęć dydaktycznych, wymiar godzin i punktów ECTS

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Semestr  (nr) | Wykł. | Ćw. | Konw. | Lab. | Sem. | ZP | Prakt. | Inne (jakie?) | **Liczba pkt. ECTS** |
| 3 |  |  |  | 15 |  |  |  |  | 2 |

1.2. Sposób realizacji zajęć

✕ zajęcia w formie tradycyjnej lub z wykorzystaniem platformy Ms Teams

☐ zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość

1.3 Forma zaliczenia przedmiotu (z toku) (egzamin, zaliczenie z oceną, zaliczenie bez oceny)

Zaliczenie z oceną

2.Wymagania wstępne

|  |
| --- |
| Student powinien posiadać podstawową wiedzę o funkcjonowaniu rynków finansowych. Ponadto wymagana jest znajomość podstawowych technik komputerowych oraz ogólna wiedza ze statystyki, ekonometrii. |

3.cele, efekty uczenia się , treści Programowe i stosowane metody Dydaktyczne

3.1 Cele przedmiotu

|  |  |
| --- | --- |
| C1 | Zapoznanie studentów z wybranymi metodami analizy ilościowej, wykorzystywanymi do analizowania danych finansowych |
| C2 | Przekazanie wiedzy teoretycznej oraz wykształcenie umiejętności praktycznego stosowania metod statystycznych do rozwiązywania rzeczywistych problemów związanych z analizą danych finansowych. |
| C3 | Wypracowanie umiejętności interpretacji wyników analiz uzyskanych w przypadku stosowanych metod. |
| C4 | Wdrożenie umiejętności obsługi profesjonalnego pakietu statystycznego STATISTICA. |

**3.2 Efekty uczenia się dla przedmiotu**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| EK (efekt uczenia się) | Treść efektu uczenia się zdefiniowanego dla przedmiotu | Odniesienie do efektów kierunkowych [[1]](#footnote-1) |
| EK\_01 | Objaśnia istotę opisu ilościowych relacji pomiędzy elementami systemu finansowego. Definiuje podstawowe pojęcia z zakresu analizy wielowymiarowej , analizy porównawczej oraz ma pogłębioną wiedzę na temat metod ilościowych stosowanych do analizy danych finansowych. | K\_W09 |
| EK\_02 | Pozyskuje dane, przeprowadza analizę badanego zjawiska na podstawie posiadanych informacji, oraz wykorzystując aplikacje komputerowe dobiera odpowiednie metody analizy statystycznej do rozwiązania konkretnego problemu. | K\_U02  K\_U05  K\_U10 |
| EK\_03 | Jest gotów do wykorzystania metod ilościowych przy opracowywaniu analiz finansowych, zaprezentowania i interpretacji wyników własnego badania w projekcie oraz wyciągnięcia wniosków. | K\_K01  K\_K03 |

**3.3Treści programowe**

1. Problematyka ćwiczeń audytoryjnych, konwersatoryjnych, laboratoryjnych, zajęć praktycznych

|  |
| --- |
| Treści merytoryczne |
| Pozyskiwanie materiału empirycznego z dostępnych baz danych. |
| Rodzaje zmiennych diagnostycznych stosowanych w badaniach finansów przedsiębiorstw (stymulanty, destymulanty i nominanty). |
| Wprowadzenie do zagadnień klasyfikacji i grupowania: klasyfikacja ze wzorcem i bezwzorcowa. Metody doboru zmiennych do modeli. Metody normalizacji i standaryzacji zmiennych. |
| Syntetyczne mierniki taksonomiczne, taksonomiczna miara atrakcyjności inwestowania (TMAI) na rynku kapitałowym. |
| Wykorzystanie wybranych miar syntetycznych (syntetyczny miernik rozwoju Hellwiga, wskaźnik względnego poziomu rozwoju) do klasyfikacji obiektów ekonomicznych (przedsiębiorstw, banków, spółek) opisanych wieloma cechami diagnostycznymi. |
| Procedury porządkowania liniowego, grupowania obiektów, sporządzania rankingów. |
| Analiza dyskryminacyjna.Dobór zmiennych diagnostycznych, sformułowanie modelu i ocena trafności klasyfikacji na podstawie modelu. |

3.4 Metody dydaktyczne

Ćwiczenia obejmują rozwiązywanie zadań (analiza rzeczywistych danych finansowych za pomocą prezentowanych metod) z wykorzystaniem komputera – praca w laboratorium. Przygotowanie projektu.

4. METODY I KRYTERIA OCENY

4.1 Sposoby weryfikacji efektów uczenia się

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Symbol efektu | Metody oceny efektów uczenia się  (np.: kolokwium, egzamin ustny, egzamin pisemny, projekt, sprawozdanie, obserwacja w trakcie zajęć) | Forma zajęć dydaktycznych  (w, ćw, …) |
| Ek\_01 | ocena aktywności w czasie zajęć, projekt | ćwiczenia |
| Ek\_02 | kolokwium, ocena aktywności w czasie zajęć | ćwiczenia |
| Ek\_03 | projekt | ćwiczenia |

4.2 Warunki zaliczenia przedmiotu (kryteria oceniania)

|  |  |
| --- | --- |
| Ćwiczenia:   * 1 kolokwium, * projekt, praca zespołowa w grupach 2 osobowych, * ocena aktywności i przygotowania do zajęć na podstawie zadanej literatury.   Ocena 3,0 wymaga zdobycia 51% maksymalnej liczby punktów przypisanych przez prowadzących zajęcia do poszczególnych aktywności składających się na zaliczenie. |  |

**5. CAŁKOWITY NAKŁAD PRACY STUDENTA POTRZEBNY DO OSIĄGNIĘCIA ZAŁOŻONYCH EFEKTÓW W GODZINACH ORAZ PUNKTACH ECTS**

|  |  |
| --- | --- |
| **Forma aktywności** | **Średnia liczba godzinna zrealizowanie aktywności** |
| Godziny kontaktowe wynikające z planu studiów | 15 |
| Inne z udziałem nauczyciela  (udział w konsultacjach) | 5 |
| Godziny niekontaktowe – praca własna studenta (przygotowanie do zajęć, przygotowanie do kolokwium, napisanie projektu) | 30 |
| SUMA GODZIN | **50** |
| **SUMARYCZNA LICZBA PUNKTÓW ECTS** | **2** |

*\* Należy uwzględnić, że 1 pkt ECTS odpowiada 25-30 godzin całkowitego nakładu pracy studenta.*

6. PRAKTYKI ZAWODOWE W RAMACH PRZEDMIOTU

|  |  |
| --- | --- |
| wymiar godzinowy |  |
| zasady i formy odbywania praktyk |  |

7. LITERATURA

|  |
| --- |
| Literatura podstawowa:   1. Łuniewska M., Tarczyński W., Metody wielowymiarowej analizy porównawczej na rynku kapitałowym, Wydawnictwo naukowe PWN, Warszawa 2006 2. Łuniewska M., Ekonometria finansowa: analiza rynku kapitałowego, Wydawnictwo naukowe PWN, Warszawa 2008. 3. Nowak E. (red.), Metody statystyczne w analizie działalności przedsiębiorstwa, PWE, Warszawa 2001 |
| Literatura uzupełniająca:  1. Gabrusewicz W., Metody analizy finansowej przedsiębiorstwa, PWE, Warszawa 2019.  2. Jajuga K., Metody ekonometryczne i statystyczne w analizie rynku kapitałowego ,  Wydawnictwo AE, Wrocław 2000. |

Akceptacja Kierownika Jednostki lub osoby upoważnionej

1. W przypadku ścieżki kształcenia prowadzącej do uzyskania kwalifikacji nauczycielskich uwzględnić również efekty uczenia się ze standardów kształcenia przygotowującego do wykonywania zawodu nauczyciela. [↑](#footnote-ref-1)