**SYLABUS**

**dotyczy cyklu kształcenia** 2018-2020

1. PODSTAWOWE INFORMACJE O PRZEDMIOCIE/MODULE

|  |  |
| --- | --- |
| Nazwa przedmiotu/ modułu | Metody ilościowe w finansach |
| Kod przedmiotu/ modułu\* | FiR/II/RiA/C-1.1a |
| Wydział (nazwa jednostki prowadzącej kierunek) | Wydział Ekonomii |
| Nazwa jednostki realizującej przedmiot | Katedra Metod Ilościowych i Informatyki Gospodarczej |
| Kierunek studiów | Finanse i rachunkowość |
| Poziom kształcenia | II stopień |
| Profil | ogólnoakademicki |
| Forma studiów | niestacjonarne |
| Rok i semestr 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 |

*\* - zgodnie z ustaleniami na Wydziale*

1.1.Formy zajęć dydaktycznych, wymiar godzin i punktów ECTS

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Semestr  (nr) | Wykł. | Ćw.lab. | Konw. | Lab. | Sem. | ZP | Prakt. | Inne (jakie?) | **Liczba pkt ECTS** |
| 3 |  | 9 |  |  |  |  |  |  | 2 |

1.2. Sposób realizacji zajęć

x zajęcia w formie tradycyjnej

☐ zajęcia realizowane z wykorzystaniem metod i technik kształcenia na odległość

1.3 Forma zaliczenia przedmiotu /modułu (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 KSZTAŁCENIA , TREŚCI PROGRAMOWE I STOSOWANE METODY DYDAKTYCZNE

3.1 Cele przedmiotu/modułu

|  |  |
| --- | --- |
| C1 | Zapoznanie studentów z wybranymi metodami analizy ilościowej. |
| 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 kształcenia dla przedmiotu/ modułu** *(wypełnia koordynator)*

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| EK (efekt kształcenia) | Treść efektu kształcenia zdefiniowanego dla przedmiotu (modułu) | Odniesienie do efektów kierunkowych (KEK) |
| EK\_01 | Objaśnia istotę opisu ilościowych relacji pomiędzy elementami systemu finansowego. Definiuje podstawowe pojęcia z zakresu analizy wielowymiarowej. | K\_W09 |
| EK\_02 | Pozyskuje dane, przeprowadza analizę badanego zjawiska na podstawie posiadanych informacji, oraz wykorzystując aplikacje komputerowe wybiera odpowiednią metodę 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 |

**3.3 Treści programowe** *(wypełnia koordynator)*

1. Problematyka ćwiczeń laboratoryjnych

|  |
| --- |
| 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: dyskusja, analiza i interpretacja danych statystycznych oraz tekstów źródłowych, rozwiązywanie zadań w oparciu o techniki komputerowe, praca w grupach

4. METODY I KRYTERIA OCENY

4.1 Sposoby weryfikacji efektów kształcenia

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Symbol efektu | Metody oceny efektów kształcenia | Forma zajęć dydaktycznych |
| ek\_01 | ocena efektywności pracy w czasie zajęć, projekt | ćwiczenia |
| ek\_02 | kolokwium, ocena efektywności pracy w czasie zajęć | ćwiczenia |
| ek\_03 | ocena projektów przygotowywanych przez studenta | 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 ilości punktów przypisanych do poszczególnych prac i aktywności składających się na zaliczenie przedmiotu. |

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

|  |  |
| --- | --- |
| **Forma aktywności** | **Średnia liczba godzin na zrealizowanie aktywności** |
| Godziny kontaktowe wynikające z planu studiów | 9 |
| Inne z udziałem nauczyciela  (udział w konsultacjach) | 5 |
| Godziny niekontaktowe – praca własna studenta (przygotowanie do zajęć, przygotowanie do kolokwium, napisanie projektu) | 36 |
| 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/ MODUŁU

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

7. LITERATURA

|  |
| --- |
| Literatura podstawowa:   1. Łuniewska M., Ekonometria finansowa: analiza rynku kapitałowego, Wydawnictwo naukowe PWN, Warszawa 2008. 2. Łuniewska M., Tarczyński W., Metody wielowymiarowej analizy porównawczej na rynku kapitałowym, Wydawnictwo naukowe PWN, Warszawa 2006. 3. Zeliaś A., Metody statystyczne, PWE, Warszawa 2002. |
| Literatura uzupełniająca:   1. Dobosz M., Wspomagana komputerowo statystyczna analiza wyników badań, EXIT, Warszawa 2001. 2. Jajuga K., Metody ekonometryczne i statystyczne w analizie rynku kapitałowego , Wydawnictwo AE, Wrocław 2000. |