

FIȘA DISCIPLINEI₁

1. Date despre program

1.1 Instituția de învățământ superior	Univeritatea Creștina Partium
1.2 Facultatea de	Științe Economice și Sociale
1.3 Departamentul de	Economie
1.4 Domeniul de studii	Finanțe
1.5 Ciclul de studii	Master
1.6 Programul de studii/Calificarea	Finanțe

2. Date despre disciplină

2.1 Denumirea disciplinei	Econometrie financiară F1104
2.2 Titularul activității de curs	Prof. dr. Fogarasi József
2.3 Titularul activității de seminar	Prof. dr. Fogarasi József
2.4 Anul de studiu	I
2.5 Semestrul	1
2.6 Tipul de evaluare	Examen
2.7 Regimul disciplinei	DA

3. Timpul total estimat

3.1 Număr de ore pe săptămână	3	din care 3.2 curs	2	3.3 seminar/laborator	1
3.4 Total ore din planul de învățământ	42	din care 3.5 curs	28	3.6 seminar/laborator	14
Distribuția fondului de timp					ore
Studiul după manual, suport de curs, bibliografie și notițe					30
Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platforme electronice de specialitate și pe teren					15
Pregătire seminarii/laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri					16
Tutoriat					4
Examinări					4
Alte activități...					-
3.7 Total ore studiu individual					69
3.8 Total ore pe semestru					125
3.9 Numărul de credite					5

4. Precondiții (acolo unde este cazul)

4.1 de curriculum	Statistică, Introducere în econometrie
4.2 de competențe	Operare calculator

5. Condiții (acolo unde este cazul)

5.1 de desfășurare a cursului	Sală de curs dotat cu proiector
5.2 de desfășurare a seminarului/laboratorului	Laborator calculatoare

1Cf.M.Of.al României, Partea I, Nr.800bis/13.XII.2011,Ordinul ministrului nr.5703 din18 oct.2011

6. Competențe specifice acumulate

Competențe profesionale	<p>CP.1. Capacitatea de a formula și rezolva probleme economico-financiare cu un aparat statistico/matematic adecvat</p> <p>CP.2. Abilități privind estimarea diferitelor tipuri de regresii</p> <p>CP.3. Aptitudini în formularea unor recomandări pentru soluționarea unor probleme economice și financiare din întreprindere sau instituție pe baza analizei econometrice</p>
Competențe transversale	<p>CT.1. Stăpânirea limbajului econometric</p> <p>CT.2. Abilități de utilizare și interpretare a instrumentului statistico-matematic specific finanțelor</p> <p>CT.3. Cunoașterea la nivel de utilizator a unor programe econometrice aplicate în econometrie financiară</p>

7. Obiectivele disciplinei (reieșind din grila competențelor specifice acumulate)

Obiectivul general al disciplinei	este însușirea tehnicilor econometrice utilizate în pregătirea deciziilor economice și financiare în cadrul întreprinderilor sau instituțiilor prin metodele moderne oferite de tehnologia informațională.
Obiectivele specifice	conform tematicii cursului sunt: formarea capacității elaborării de cercetări a diferitelor teme economice și financiare de interes în cadrul întreprinderii sau instituției cu un aparat metodologic avansat, și familiarizarea studenților cu programul econometric STATA.

8. Conținuturi

8.1 Curs	Metode de predare	Nr. ore
1. Introducere	Prelegere-problematizare	2
2. Regresia lineară simplă - univariată	Prelegere-problematizare	2
3. Regresia lineară multiplă - multivariată	Prelegere-problematizare	2
4. Definierea și testarea reresiilor lineare multiple	Prelegere-problematizare	2
5. Introducere în analiza seriilor de timp	Prelegere-problematizare	2
6. Modele cu variabile categorice	Prelegere-problematizare	2
7. Regresii quantilice	Prelegere-problematizare	2
8. Regresii robuste	Prelegere-problematizare	2
9. Modele autoregresive	Prelegere-problematizare	2
10. Cointegrarea	Prelegere-problematizare	2
11. Modele autoregresive heteroskedastice	Prelegere-problematizare	2
12. Analiza factorială și componentelor principale	Prelegere-problematizare	2
13. Estimarea și specificarea modelelor	Prelegere-problematizare	2
14. Formularea și implementarea strategiilor de investiții	Prelegere-problematizare	2

8.2 Seminar	Metode de predare	Nr. ore
1. Analiza datelor	Aplicații și exerciții STATA	1
2. Estimarea modelelor lineare simple	Aplicații și exerciții STATA	1
3. Estimarea modelelor lineare multiple	Aplicații și exerciții STATA	1
4. Analize și aplicații cu regresia lineară multiplă	Aplicații și exerciții STATA	1
5. Aplicații – trend și sezonaliitate	Aplicații și exerciții STATA	1
6. Aplicații – testarea variabilelor categorice	Aplicații și exerciții STATA	1
7. Modelarea seriilor de timp cu regresii quantilice	Aplicații și exerciții STATA	1
8. Aplicații regresiiilor robuste în soluționarea probl. financiare	Aplicații și exerciții STATA	1
9. Modelarea regresiiilor autoregresive (ARMA)	Aplicații și exerciții STATA	1
10. Testarea cointegrăției	Aplicații și exerciții STATA	1
11. Estimarea modelelor ARCH și GARCH	Aplicații și exerciții STATA	1
1. Aplicații cu analiza factorială	Aplicații și exerciții STATA	1
2. Aplicații cu analiz componentelor principale	Aplicații și exerciții STATA	1
14. Evaluarea activității studenților la seminarii	Aplicații și exerciții STATA	1

Bibliografie

1. Fabozzi, F.J., Focardi, S.M., Rachev, S.T., Archanapalli, B.G. [2014]: The Basics of Financial Econometrics, New Jersey: Wiley.
2. Brooks, Chris [2008]: Introductory Econometrics for Finance. Second edition, Cambridge University Press.
3. Békés, G. és Kézdi, G. [2021]: Data Analysis for Business, Economics and Policy. Cambridge University Press.
4. Săvoiu, G.-Manea, C. [2013]: De la economia financiară la econometria financiară. Gândire econometrică aplicată în economia financiară. Revista Română de Statistică, 3/2013 55-65.
5. Vargha András [2003]: Robusztussági vizsgálatok az egymintás t-róbával (Analiza robusteții cu proba t). Statisztikai Szemle, 81(10): 872-890.

9. Coroborarea conținuturilor disciplinei cu așteptările reprezentanților comunității epistemice, asociațiilor profesionale și angajatori reprezentativi din domeniul aferent programului

Absolvenții acestui curs dobândesc capacitatea pregătirii deciziilor în cadrul unei întreprinderi sau instituții utilizând un aparat statistico/matematic performant. Capacitatea estimării elasticității cererii față de venit pentru produsele sau serviciile oferite de o întreprindere sau elasticitatea produselor față de preț reprezintă un avantaj pentru fiecare întreprindere.

Aplicațiile practice rezolvate pe calculator oferă posibilitatea creșterii operativității și eficienței soluționării unor probleme concrete economice și/sau simple sau complexe în cadrul întreprinderii.

10. Evaluare

Tip activitate	10.1 Criterii de evaluare	10.2 Metode de evaluare	10.3 Pondere din nota finală
10.4 Curs	Obținerea notei de promovare la seminar	Test grilă	70%
10.5 Seminar	Proiect empiric propriu	Oral și scris	30%
10.6 Standard minim de performanță: obținerea notei 5 la examen			

Data completării

Semnătura titularului de curs

Semnătura titularului de seminar

15 septembrie 2024

.....

.....

Data avizării în departament

Semnătura directorului de departament

.....

.....