



Karta przedmiotu

Nazwa i kod przedmiotu	FINANCIAL ECONOMETRICS, PG_00067643						
Kierunek studiów	Analityka gospodarcza (studia w jęz. angielskim)						
Data rozpoczęcia studiów	październik 2025 r.	Rok akademicki realizacji przedmiotu			2026/2027		
Poziom kształcenia	II stopnia	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	stacjonarne	Sposób realizacji			na uczelni		
Rok studiów	2	Język wykładowy			polski		
Semestr studiów	3	Liczba punktów ECTS			3.0		
Profil kształcenia	ogólnoakademicki	Forma zaliczenia			zaliczenie		
Jednostka prowadząca	Wydziały Politechniki Gdańskiej -> Wydział Zarządzania i Ekonomii -> Katedra Statystyki i Ekonometrii						
Imię i nazwisko wykładowcy (wykładowców)	Odpowiedzialny za przedmiot						
	Prowadzący zajęcia z przedmiotu						
Formy zajęć i metody nauczania	Forma zajęć	Wykład	Ćwiczenia	Laboratorium	Projekt	Seminarium	RAZEM
	Liczba godzin zajęć	30.0	0.0	30.0	0.0	0.0	60
	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	60		5.0		10.0	75
Cel przedmiotu	Formułuje złożone modele procesów stochastycznych na rynku kapitałowym, wykorzystując w pogłębiony sposób wiedzę i techniki rozwiązywania problemów, zgodnie ze współczesnymi trendami rozwoju tego obszaru badawczego						
Efekty uczenia się przedmiotu	Efekt kierunkowy		Efekt z przedmiotu		Sposób weryfikacji i oceny efektu		
	[K7_W02] zna i rozumie znaczenie oraz wzajemne zależności kluczowych składowych opisujących procesy gospodarcze, opierając się na pogłębionej wiedzy zgodnej z głównymi trendami rozwoju dyscyplin naukowych związanych z kierunkiem studiów analityka gospodarcza.		analizuje procesy stochastyczne na rynku finansowym interpretując ich kluczowe składowe oraz ich relacje, wykorzystując współczesne osiągnięcia naukowe		[SW1] Ocena wiedzy faktograficznej		
	[K7_U03] potrafi formułować hipotezy badawcze i dobrać właściwe metody ich weryfikacji, wykorzystując zaawansowane narzędzia informatyczne.		modeluje procesy stochastyczne na rynku kapitałowym, dobierając odpowiednie do sformułowanego problemu badawczego metody analityczne i dane finansowe		[SU3] Ocena umiejętności wykorzystania wiedzy uzyskanej w ramach przedmiotu		
Treści przedmiotu	Procesy stochastyczne na rynku finansowym, podstawowe charakterystyki, przykłady empiryczne Proces pozyskiwania danych finansowych przez instytucje, źródła pozyskiwania danych, ograniczenia instytucjonalne Problem udostępniania i dystrybucji danych finansowych przez instytucje, dostępność danych finansowych Trend deterministyczny czy trend stochastyczny - testy stacjonarności i pierwiastka jednostkowego Modelowanie stacjonarnych procesów stochastycznych rynku finansowego Modelowanie niestacjonarnych procesów stochastycznych rynku finansowego Jednorównaniowy model korekty błędem, modelowanie kointegracji procesów stochastycznych Jednowymiarowe modele zmienności, modele z rodziny GARCH, modele zmienności stochastycznej (SV) Wielorównaniowe modele procesów stochastycznych VAR i SVAR na rynkach finansowych Badanie kointegracji procesów stochastycznych Wektorowy model korekty błędem VECM Problem przyczynowości Grangera Wielorównaniowe modele zmienności z rodziny GARCH Problem zarażania na rynkach finansowych						

Wymagania wstępne i dodatkowe			
Sposoby i kryteria oceniania osiąganych efektów uczenia się	Sposób oceniania (składowe)	Próg zaliczeniowy	Składowa oceny końcowej
	Egzamin	60.0%	60.0%
	Kolokwium	60.0%	40.0%
Zalecana lista lektur	Podstawowa lista lektur	Enders W. (1995) Applied Econometric Time Series. Wiley	
	Uzupełniająca lista lektur	Enders W. (1995) Applied Econometric Time Series. Wiley Maddala G.S.(2006) Ekonometria, PWN, Warszawa	
	Adresy eZasobów	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.