

**FIȘA DISCIPLINEI- MF
ECONOMETRIE FINANCIARĂ
2023-2024**

1. Date despre program

1.1. Instituția de învățământ superior	Universitatea Ecologică din București
1.2. Facultatea	Management Financiar
1.3. Departamentul	Științe Economice
1.4. Domeniul de studii	Finanțe
1.5. Ciclul de studii	Masterat- nivel 7
1.6. Programul de studii/ Calificarea	Management Financiar
1.7. Limba de studiu	Română

2. Date despre disciplină

2.1 Denumirea disciplinei		ECONOMETRIE FINANCIARĂ			
2.2 Titularul/titularii activităților de curs		Prof.univ.dr. Dorin JULA		Email (adresa instituțională): dorin.jula@ueb.education	
2.3 Titularul/titularii activităților de seminar		Prof.univ.dr.Lucian Liviu ALBU		Email (adresa instituțională): lucian.albu@ueb.education	
2.4 Anul de studiu	I	2.5 Semestrul	II	2.6 Tipul de evaluare	Examen
				2.7 Regimul disciplinei	DA O (Disciplină de aprofundare, Disciplină obligatorie)
2.8. Numărul de credite ECTS			8		

3. Timpul total estimat (ore pe semestru al activităților didactice)

3.1 Număr de ore pe săptămână	4	din care: 3.2 curs	2	3.3 seminar/laborator	2
3.4 Total ore din planul de învățământ	56	din care: 3.5 curs	28	3.6 seminar/laborator	28
3.7. Total ore de studiu pe semestru (număr ECTS * 25 ore)					200
3.8. Total ore studiu individual (3.7. – 3.4.)					144
<i>Distribuția fondului de timp de studiu individual</i>					<i>ore</i>
Studiul după manual, suport de curs, bibliografie și notițe					56
Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platformele electronice de specialitate și pe teren					50
Pregătire seminarii/laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri					34
Tutoriat					-
Examinări					4
Alte activități.....					-

4. Precondiții (acolo unde este cazul)

4.1 de curriculum	
4.2 de competențe	- cunoștințe Office – EXCEL, Power Point

5. Condiții (acolo unde este cazul)

5.1. de desfășurare a cursului	<ul style="list-style-type: none"> • cont Google Classroom în domeniul @ueb.education, • sală de curs dotată cu videoproiector, ecran, tablă și instrumente de scris 	•
5.2. de desfășurare a	<ul style="list-style-type: none"> • cont Google Classroom în domeniul @ueb.education, 	•

6. Competențele specifice acumulate

Competențe profesionale	<p>C2. Realizarea de studii și lucrări complexe utilizând instrumentarul de analiză și previziune financiară în diagnosticarea performanțelor financiare și în proiectarea creșterii durabile a acestora la nivelul entităților/organizațiilor publice sau private</p> <p>C2.3 Aplicarea metodelor clasice și a celor moderne de analiză și previziune financiară la nivelul entităților/organizațiilor publice sau private</p> <p>C2.4 Utilizarea pertinentă a metodelor de analiză și previziune financiară în scopul fundamentării deciziilor financiare la nivelul entităților/organizațiilor publice sau private</p> <p>C2.5 Utilizarea inovativă a metodelor și modelelor clasice combinate cu cele moderne de analiză și previziune financiară în scopul fundamentării unor noi strategii de creștere durabilă a performanțelor financiare la nivelul entităților/organizațiilor publice sau private</p> <p>C3. Realizarea activităților de analiză, sinteză și proiectare în domeniul financiar cu privire la gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor, implicații ale cadrului legislativ și normativ asupra activității financiare</p> <p>C3.1 Identificarea și definirea conceptelor, teoriilor și practicilor de lucru privind gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor precum și a celor legate de reglementarea și supravegherea financiară</p> <p>C3.2 Explicarea, interpretarea și dezvoltarea teoriilor și practicilor de lucru privind gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor, precum și a celor legate de reglementarea și supravegherea financiară</p> <p>C3.3 Aplicarea integrată a practicilor de lucru privind gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor precum și a celor legate de reglementarea și supravegherea financiară</p> <p>C3.4 Selectarea și utilizarea pertinentă a conceptelor, teoriilor și practicilor de lucru privind gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor precum și a celor legate de reglementarea și supravegherea bancară în scopul formulării de judecăți de valoare și al fundamentării deciziilor financiare</p> <p>C3.5 Valorificarea conceptelor, teoriilor și practicilor de lucru avansate privind gestiunea activelor și pasivelor, gestiunea riscurilor și performanțelor pentru fundamentarea de noi strategii de creștere a competitivității organizațiilor</p> <p>C4. Realizarea de studii aprofundate privind investițiile financiare și gestiunea portofoliilor, oportunitățile de finanțare eficiente pentru fundamentarea financiară a planurilor de afaceri.</p> <p>C4.2 Explicarea mecanismului tranzacțiilor bursiere, a metodelor și tehnicilor de operare pe piața bursieră, a modelelor de gestiune a portofoliului de active financiare și a criteriilor de selectare a surselor de finanțare la nivelul entităților/organizațiilor publice sau private</p> <p>C4.4 Evaluarea portofoliilor de active financiare, utilizarea și selectarea criteriilor de determinare a surselor de finanțare utilizând modele avansate de optimizare a acestora</p>
Competențe transversale	<p>CT2 Dezvoltarea capacității de adoptare și urmărire a implementării deciziilor de natură financiară</p>

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

7.1 Obiectivul general al disciplinei	Formarea cunoștințelor de bază necesare analizei datelor experimentale din domeniul economic și, în special, oferă noțiunile de bază privind utilizarea metodelor econometrice în domeniul testării ipotezelor, analizei, calculului economic și prognozei economico-financiare și monetare.
7.2 Obiectivele specifice	<p>Prezentarea principalelor teorii și metode de analiză din structura de bază a demersului econometric (noțiuni generale privind modelarea în economie, estimarea parametrilor în modelele econometrice, modelul linear unifactorial și multifactorial, heteroscedasticitatea și autocorelarea erorilor, modele econometrice cu ecuații simultane, prognoza econometrică).</p> <p>Prezentarea modului de construire și rezolvare a modelelor econometrice în domeniile fundamentale ale analizei financiare și monetare (modele financiare la nivel de firmă, modelarea pieței monetare, modelarea pieței capitalurilor, modelarea politicii fiscale, modele privind datoria publică internă și externă, modelarea proceselor de convergență economică).</p> <p>Prezentarea modului de utilizare a instrumentelor de analiză econometrică din corpul metodologic general, precum și instrumentele specifice analizei în domenii specializate ale economiei naționale</p>

8. Conținuturi

8. 1 Curs	Metode de predare	Observații /nr. ore
1. Noțiuni generale privind modelarea în economie	Prelegere, exemplificări	1
2. Modelul linear unifactorial și multifactorial	Prelegere, exemplificări	1
3. Estimarea parametrilor în modelele econometrice	Prelegere, exemplificări	4
4. Heteroscedasticitatea și autocorelarea erorilor	Prelegere, exemplificări	2
5. Modele econometrice cu ecuații simultane	Prelegere, exemplificări	2
6. Analiza seriilor de timp	Prelegere, exemplificări	2
7. Staționaritate și cointegrare	Prelegere, exemplificări	2
8. Modele de tip ARIMA, ARCH, GARCH	Prelegere, exemplificări	4
9. Modele de tip VAR	Prelegere, exemplificări	4
10. Modele autocorectoare de erori	Prelegere, exemplificări	2
11. Modele econometrice în domeniile fundamentale ale analizei financiare	Prelegere, exemplificări	4
Total ore		28
Bibliografie		
<ol style="list-style-type: none">1. Andrei T., Bourbonnais R., 2008, <i>Econometrie</i>, Editura Economică, București2. Dobrescu E., 2012, <i>Tranziția în România. Abordări econometrice</i>, Editura Economică, București3. Greene W.H., 2011, <i>Econometric analysis</i>, 6th edition, Prentice Hall, New Jersey4. Jula D., Jula N., 2009, <i>Econometrie financiară</i>, Editura Mustang, București5. Jula D., Jula N.M., 2022, <i>Econometrie</i>, Editura Mustang, București6. Jula N., Jula D., 2017 <i>Modelare economică – elemente de econometrie aplicată</i>, Editura Mustang, București7. Maddala G.S., 2001, <i>Introduction to econometrics</i>, third edition, Wiley, New Yorkești		
8. 2 Seminar/laborator	Metode de predare	Observații / nr. ore
1. Modelul linear unifactorial și multifactorial	Aplicații practice.	4
2. Estimarea parametrilor în modelele econometrice	Aplicații practice.	2
3. Heteroscedasticitatea și autocorelarea erorilor	Aplicații practice.	2
4. Modele econometrice cu ecuații simultane	Aplicații practice.	4
5. Analiza seriilor de timp	Aplicații practice.	2
6. Staționaritate și cointegrare	Aplicații practice.	4
7. Modele de tip ARIMA, ARCH, GARCH	Aplicații practice.	2
8. Modele de tip VAR	Aplicații practice.	2
9. Modele autocorectoare de erori	Aplicații practice.	2
10. Modele econometrice în domeniile fundamentale ale analizei financiare	Aplicații practice.	4
Total ore		28
Bibliografie		
<ol style="list-style-type: none">1. Andrei T., Bourbonnais R., 2008, <i>Econometrie</i>, Editura Economică, București2. Dobrescu E., 2012, <i>Tranziția în România. Abordări econometrice</i>, Editura Economică, București3. Greene W.H., 2011, <i>Econometric analysis</i>, 6th edition, Prentice Hall, New Jersey4. Jula D., Jula N., 2009, <i>Econometrie financiară</i>, Editura Mustang, București5. Jula D., Jula N.M., 2022, <i>Econometrie</i>, Editura Mustang, București6. Maddala G.S., 2001, <i>Introduction to econometrics</i>, third edition, Wiley, New York		

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

Conținutul disciplinei *Econometrie financiară* are în vedere însușirea de către studenți a aspectelor de natură financiară.

Se asigură, în acest fel, accesul la ocupații specifice domeniului finanțe conform COR.

Ocupații posibile :

- Manager de fond acțiuni/obligațiuni 241212
- Expert fiscal 241221
- Manager bancă 241225
- Analist bancar/societate de leasing 241229
- Consultant bancar 241234
- Analist credite 241241
- Consultant de investiții 241269
- Specialist pentru piața de capital 241271

Elaborarea fișei disciplinei s-a realizat prin consultarea unor specialiști din domeniu și cadre didactice din alte instituții de învățământ superior. Au fost identificate astfel nevoile și așteptărilor angajatorilor din domeniul finanțe.

10. Evaluare

Tip activitate	10.1 Criterii de evaluare	10.2 Metode de evaluare	10.3 Pondere din nota finală
10.4 Curs	Înțelegerea și însușirea conceptelor tratate la curs.	Evaluarea participării active la dezbateri	10%
10.5 Seminar/laborator	Teste de control	Test scris	10%
	Înțelegerea și însușirea algoritmilor de calcul ai indicatorilor exemplificați la seminar.	Evaluarea unui proiect care să conțină rezolvarea unei probleme complexe	20%
10.6. Evaluarea finală	Înțelegerea și însușirea conceptelor tratate la curs și a algoritmilor de calcul ai indicatorilor exemplificați la seminar.	Examen scris în campus sau online, în acord cu reglementările interne care vor fi adoptate în funcție de evoluția contextului epidemiologic	60%
10.7. Modalitatea de notare (calificativ sau notă): notă			
10.8. Standard minim de performanță: <ul style="list-style-type: none">• Minim 50% din punctajul aferent examenului.• Elaborarea și prezentarea unui proiect pe probleme specifice domeniului econometriei financiare.			

Data completării

04.09.2023

Semnătura titularului/titularilor curs

Semnătura titularului/titularilor de seminar

Data avizării în departament

05.09.2023

Semnătura directorului de departament