

**FIȘA DISCIPLINEI- MF
ECONOMETRIE FINANCIARĂ
2024-2025**

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, București 2. Dobrescu E., 2012, <i>Tranziția în România. Abordări econometrice</i>, Editura Economică, București 3. Greene W.H., 2011, <i>Econometric analysis</i>, 6th edition, Prentice Hall, New Jersey 4. Jula D., Jula N., 2009, <i>Econometrie financiară</i>, Editura Mustang, București 5. Jula D., Jula N.M., 2022, <i>Econometrie</i>, Editura Mustang, București 6. Jula N., Jula D., 2017 <i>Modelare economică – elemente de econometrie aplicată</i>, Editura Mustang, București 7. 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. | 2 |
| 11. Utilizarea soft-urilor specializate pentru modelarea seriilor de timp (EViews) | Aplicații practice. | 2 |
| Total ore | | 28 |
| Bibliografie | | |
| <ol style="list-style-type: none"> 1. Andrei T., Bourbonnais R., 2008, <i>Econometrie</i>, Editura Economică, București 2. Dobrescu E., 2012, <i>Tranziția în România. Abordări econometrice</i>, Editura Economică, București 3. Greene W.H., 2011, <i>Econometric analysis</i>, 6th edition, Prentice Hall, New Jersey 4. Jula D., Jula N., 2009, <i>Econometrie financiară</i>, Editura Mustang, București 5. Jula D., Jula N.M., 2022, <i>Econometrie</i>, Editura Mustang, București 6. 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

02.09.2024

Semnătura titularului/titularilor curs

Semnătura titularului/titularilor de seminar

Data avizării în departament

09.09.2024

Semnătura directorului de departament