



## FIȘA DISCIPLINEI

### 1. Date despre program

|                                       |   |
|---------------------------------------|---|
| 1.1 Instituția de învățământ superior | Universitatea “Alexandru Ioan Cuza” din Iași              |
| 1.2 Facultatea                        | Facultatea de Economie și Administrarea Afacerilor        |
| 1.3 Departamentul                     | Departamentul de Finanțe, Monedă și Administrație Publică |
| 1.4 Domeniul de studii                | Finanțe   |
| 1.5 Ciclu de studii                   | Master  |
| 1.6 Programul de studii / Calificarea | Finanțe - Asigurări                                       |

### 2. Date despre disciplină

|  |                                     |              |   |                     |      |                         |    |
|--|-------------------------------------|--------------|---|---------------------|------|-------------------------|----|
| 2.1 Denumirea disciplinei              | Metode de Cercetare în Finanțe      |              |   |                     |      |                         |    |
| 2.2 Titularul activităților de curs    | Prof. Dr. Abil. Alin Marius Andrieș |              |   |                     |      |                         |    |
| 2.3 Titularul activităților de seminar | Asist. Dr. Nicu Sprincean           |              |   |                     |      |                         |    |
| 2.4 An de studiu                       | 2                                   | 2.5 Semestru | 2 | 2.6 Tip de evaluare | E(P) | 2.7 Regimul disciplinei | OB |

\* OB – Obligatoriu / OP – Opțional

### 3. Timpul total estimat (ore pe semestru și activități didactice)

|  |    |                    |    |                       |     |
|--|----|--------------------|----|-----------------------|-----|
| 3.1 Număr de ore pe săptămână  | 3  | din care: 3.2 curs | 1  | 3.3 seminar/laborator | 2   |
| 3.4 Total ore din planul de învățământ   | 42 | din care: 3.5 curs | 14 | 3.6 seminar/laborator | 28  |
| Distribuția fondului de timp   |    |                    |    |                       | ore |
| Studiu după manual, suport de curs, bibliografie și altele                                     |    |                    |    |                       | 60  |
| Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platformele electronice de specialitate și pe teren |    |                    |    |                       | 30  |
| Pregătire seminarii/laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri                          |    |                    |    |                       | 36  |
| Tutoriat   |    |                    |    |                       | 10  |
| Examinări  |    |                    |    |                       | 2   |
| Alte activități.....   |    |                    |    |                       |     |
| 3.7 Total ore studiu individual  |    |                    |    |                       | 138 |
| 3.8 Total ore pe semestru  |    |                    |    |                       | 180 |
| 3.9 Număr de credite   |    |                    |    |                       | 6   |

### 4. Precondiții (dacă este cazul)

|                   |  |
|-------------------|--|
| 4.1 De curriculum |  |
| 4.2 De competențe |  |

### 5. Condiții (dacă este cazul)

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| 5.1 De desfășurare a cursului | <b>Conduita în cadrul orelor de curs:</b><br>Studentii trebuie să aibă o conduită responsabilă și respectuasă față de colegii și cadre didactice. Conduita care perturbă în mod nejustificat sau interferează cu derularea normală a activității, nu este acceptabilă.<br><b>Prezența la orele de curs:</b> |
|-------------------------------|---|





|  |   |
|--|---|
|  | Prezența la cursuri este recomandată.   |
| 5.2 De desfășurare a seminarului/laboratorului | <b>Conduita în cadrul orelor de seminar:</b><br>Studentii trebuie să aibă o conduită responsabilă și respectuasă față de colegii și cadre didactice. Conduita care perturbă în mod nejustificat sau interferează cu derularea normală a activității, nu este acceptabilă.<br><b>Prezența la orele de seminar:</b><br>Prezența este obligatorie la cel puțin 80% dintre activitățile de seminar. În cazul absenței, profesorul trebuie să fie informat în prealabil. |

## 6. Competențe specifice acumulate

|                         |   |
|-------------------------|---|
| Competențe profesionale | <b>C1.</b> Analiza aspectelor teoretice și practice ale piețelor, modelelor și instrumentelor financiare utilizate în managementul riscurilor.<br><b>C2.</b> Utilizarea adecvată a conceptelor, metodelor și tehnicilor matematice și statistice în evaluarea riscurilor și în realizarea de cercetare independentă în finanțe.   |
| Competențe transversale | <b>CT1.</b> Aplicarea normelor și valorilor de etică profesională pentru luarea deciziilor și realizarea independentă sau în grup a unor sarcini complexe.<br><b>CT2.</b> Planificarea resurselor umane în cadrul unui grup sau unei organizații, în contextul conștientizării responsabilității pentru rezultatele profesionale. |

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

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 7.1. Obiectivul general    | Acest curs oferă o introducere în metodele de cercetare și modelele econometrice și aplicarea acestora în domeniul finanțe. Accentul este pus pe aspectele practice și utilizarea software-urilor statistice și econometrice (EViews).   |
| 7.2. Obiectivele specifice | La finalizarea cu succes a acestei discipline, studenții vor fi capabili să: <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Analizeze date și să testeze ipoteze.</li><li>▪ Înțeleagă și să evalueze critic articolele științifice din literatura de specialitate.</li><li>▪ Realizarea unei lucrări științifice de tip articol, care este prezentat în mod logic și profesional.</li><li>▪ Comunicarea ideilor într-un mod succint și clar.</li><li>▪ Lucreze în echipă.</li></ul> |

## 8. Conținut





| 8.1 | Curs   | Metode de predare             | Observații<br>(ore și referințe bibliografice) |
|-----|--|-------------------------------|--|
| 1.  | Introducere                                      | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SLT2009 Cap. 1)                           |
| 2.  | Formularea și definitivarea temei de cercetare.  | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SLT2009 Cap. 2)                           |
| 3.  | Revizuirea critică a literaturii de specialitate | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SLT2009 Cap. 3)                           |
| 4.  | Definirea strategiei de cercetare                | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SLT2009 Cap. 4)                           |
| 5.  | Definirea strategiei de cercetare                | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SLT2009 Cap. 4)                           |
| 6.  | Analiza de regresie                              | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (CMC2010 Cap. 2 și 3)                      |
| 7.  | Analiza de regresie                              | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (CMC2010 Cap. 2 și 3)                      |
| 8.  | Endogeneitate și cauzalitate                     | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (CMC2010 Cap. 2 și 3)                      |
| 9.  | Analiza datelor de tip panel                     | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (CMC2010 Cap. 6)                           |
| 10. | Studiul econometric de eveniment                 | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (B2008 Cap. 14)                            |
| 11. | Studiul econometric de eveniment                 | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (B2008 Cap. 14)                            |
| 12. | Analiza de tip Diff-in-Diff                      | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SW2011 Cap. 12 și 13)                     |
| 13. | Analiza de tip Diff-in-Diff                      | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SW2011 Cap. 12 și 13)                     |
| 14. | Analiza de tip Diff-in-Diff                      | Predare și dezbateri în clasă | 1 h (SW2011 Cap. 12 și 13)                     |

**Bibliografie****Referințe principale:**

- Codirlaşu, A., Moinescu, B., Chidesciuc, N.A., Econometrie avansată. 2010 (CMC2010)
- Saunders, M, Lewis, PH., Thornhill, A., Research Methods for Business Students, Pearson: Harlow, 2009 (SLT2009)
- Stock, J. H., Watson, M. W. Introduction to Econometrics, Third Edition, Pearson, 2011 (SW2011)
- Benninga, S., Financial modeling, 3rd ed., MIT Press, 2008 (B2008)
- Brooks, C., 2008. Introductory Econometrics for Finance. 2nd edition. Cambridge University Press.
- Gujarati, D. N., Porter, D. C. Basic Econometrics. 5th edition. McGraw Hill. 2009
- Wooldridge, J. M. (2006) Introductory Econometrics: A Modern Approach. 3rd edition, Thomson South Western, 2006
- Necula, C. Econometrie. Supert de curs. 2011

**Referințe suplimentare:**

Vor fi oferite pe perioada derulării cursului prin intermediul platformei FEAA.





| 8.2 | Seminar / Laborator                             | Metode de predare          | Observații<br>(ore și referințe bibliografice) |
|-----|---|----------------------------|--|
| 1.  | Introducere                                     | Discuții în grup, Simulări | 2 h (SLT2009 Cap. 1)                           |
| 2.  | Formularea și definitivarea temei de cercetare. | Discuții în grup, Simulări | 2 h (SLT2009 Cap. 2)                           |
| 3.  | Intro in EViews                                 | Discuții în grup, Simulări | 2 h (EViews Tutorials)                         |
| 4.  | Intro in EViews                                 | Discuții în grup, Simulări | 2 h ( EViews Tutorials)                        |
| 5.  | Intro in EViews                                 | Discuții în grup, Simulări | 2 h ( EViews Tutorials)                        |
| 6.  | Analiza de regresie                             | Discuții în grup, Simulări | 2 h (CMC2010 Cap. 2 si 3)                      |
| 7.  | Analiza de regresie                             | Discuții în grup, Simulări | 2 h (CMC2010 Cap. 2 si 3)                      |
| 8.  | Endogeneitate si cauzalitate                    | Discuții în grup, Simulări | 2 h (CMC2010 Cap. 2 si 3)                      |
| 9.  | Analiza datelor de tip panel                    | Discuții în grup, Simulări | 2 h (CMC2010 Cap. 6)                           |
| 10. | Studiul econometric de eveniment                | Discuții în grup, Simulări | 2 h (B2008 Cap. 14)                            |
| 11. | Studiul econometric de eveniment                | Discuții în grup, Simulări | 2 h (B2008 Cap. 14)                            |
| 12. | Analiza de tip Diff-in-Diff                     | Discuții în grup, Simulări | 2 h (SW2011 Cap. 12 si 13)                     |
| 13. | Analiza de tip Diff-in-Diff                     | Discuții în grup, Simulări | 2 h (SW2011 Cap. 12 si 13)                     |
| 14. | Analiza de tip Diff-in-Diff                     | Discuții în grup, Simulări | 2 h (SW2011 Cap. 12 si 13)                     |

**Bibliografie****Referințe principale:**

- EViews Tutorials <http://www.eviews.com/Learning/index.html>
- Codirlaşu, A., Moinescu, B., Chidesciuc, N.A., Econometrie avansată. 2010 (CMC2010)
- Saunders, M, Lewis, PH., Thornhill, A., Research Methods for Business Students, Pearson: Harlow, 2009 (SLT2009)
- Stock, J. H., Watson, M. W. Introduction to Econometrics, Third Edition, Pearson, 2011 (SW2011)
- Benninga, S., Financial modeling, 3rd ed., MIT Press, 2008 (B2008)
- Brooks, C., 2008. Introductory Econometrics for Finance. 2nd edition. Cambridge University Press.
- Gujarati, D. N., Porter, D. C. Basic Econometrics. 5th edition. McGraw Hill. 2009
- Wooldridge, J. M. (2006) Introductory Econometrics: A Modern Approach. 3rd edition, Thomson South Western, 2006
- Necula, C. Econometrie. Supert de curs. 2011

**Referințe suplimentare:**

Vor fi oferite pe perioada derulării cursului prin intermediul platformei FEAA.



**9. Coroborarea conținutului disciplinei cu așteptările reprezentanților comunității, asociațiilor profesionale și angajatorilor reprezentativi din domeniul aferent programului**

Cursul oferă studenților cunoștințele de bază, competențele și abilitățile general acceptate și aplicate de profesioniștii în finanțe și investiții din întreaga lume. Tematica este selectată în concordanță cu cerințele certificărilor mondiale de referință în finanțe. Conținutul disciplinei este corelat cu cel al unor cursuri similare predate la universități de renume pe plan mondial și este actualizat în permanență în baza feedback-ului oferit de studenți și absolvenți.

Mai mult, acesta este un curs orientat pe student care urmează cele mai bune practice în învățare și predare pentru ciclul de master, prin adoptarea unei varietăți de metode de instruire specifice învățării active.

**10. Evaluare**

| Tip activitate  | 10.1 Criterii de evaluare  | 10.2 Metode de evaluare           | 10.3 Pondere în nota finală (%) |
|---|--|-----------------------------------|---------------------------------|
| 10.4 Curs   | Lucrarea de cercetare presupune colectarea și analiza unor date financiare pe tema lucrării de cercetare<br>6 criterii vor fi utilizate în evaluarea lucrării de cercetare: <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Calitatea întrebărilor de cercetare și motivarea problemei analizate;</li><li>▪ Calitatea revizuirii literaturii;</li><li>▪ Adecvarea metodelor de cercetare utilizate;</li><li>▪ Calitatea datelor utilizate și modul de raportare;</li><li>▪ Calitatea analizei și a interpretărilor;</li><li>▪ Calitatea lucrării în ansamblu</li></ul> | Lucrarea de cercetare             | 50%                             |
| 10.5 Seminar/ Laborator   | Claritatea de prezentării și a ideilor și calitatea argumentației, introducerii și a concluziilor în prezentarea studiului   | Prezentarea lucrării de cercetare | 20%                             |
|   | Corectitudinea rezolvării  | Teme individuale                  | 30%                             |
| <b>10.6 Standard minim de performanță</b>   |  |                                   |                                 |
| Nota de trecere minimă este 5, calculată ca $P = 0,50 \cdot CS + 0,20 \cdot CP + 0,30 \cdot TI$ , unde P - nota finală, CS - Calitatea studiului, CP - Calitatea prezentării, și TI - teme individuale. |  |                                   |                                 |

Data completării  
21.09.2020

Titular de curs  
Prof. Dr. Abil. Alin Marius Andrieș

Titular de seminar  
Asist. Dr. Nicu Sprincean

Data avizării  
24.09.2021

Director de departament  
Prof. Dr. Ovidiu STOICA

