

FIȘA DISCIPLINEI

1. Date despre program

1.1 Instituția de învățământ superior	Universitatea de Vest din Timișoara
1.2 Facultatea / Departamentul	Fizică și Matematică / Matematică
1.3 Departamentul	Matematică
1.4 Domeniul de studii	Matematică
1.5 Ciclul de studii	Masterat
1.6 Programul de studii / Calificarea	Matematici financiare / Expert matematician - ESCO 2120.5 Specialist statistică - ESCO 2120.6 Matematician actuar - ESCO 2120.1 Inspector de specialitate actuar – cod COR 212007 Expert actuar – cod COR 212006.

2. Date despre disciplină

2.1 Denumirea disciplinei	Serii de timp cu aplicații						
2.2 Titularul activităților de curs	Dan Popovici						
2.3 Titularul activităților de seminar	Dan Popovici						
2.4 Anul de studiu	I	2.5 Semestrul	1	2.6 Tipul de evaluare	E	2.7 Regimul disciplinei	DS/ DOP

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
Distribuția fondului de timp:					ore
Studiul după manual, suport de curs, bibliografie și notițe					60
Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platformele electronice de specialitate / pe teren					20
Pregătire seminare / laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri					60
Tutoriat					12
Examinări					10
Alte activități					7
3.7 Total ore studiu individual	169				
3.8 Total ore pe semestru	225				
3.9 Numărul de credite	9				

4. Precondiții (acolo unde este cazul)

4.1 de curriculum	Analiză matematică; Probabilități; Procese stochastice
4.2 de competențe	Cunoașterea noțiunilor de bază / proprietăților fundamentale ale proceselor stochastice

5. Condiții (acolo unde este cazul)

5.1 de desfășurare a cursului	Sală de curs dotată cu videoproiector; Software matematic R / interfața grafică Rstudio; Aplicații Google; Moodle (platforma e-learning)
5.2 de desfășurare a seminarului / laboratorului	Sală de curs dotată cu videoproiector; Software matematic R / interfața grafică Rstudio; Aplicații Google; Moodle (platforma e-learning)

6. Obiectivele disciplinei - rezultate așteptate ale învățării la formarea cărora contribuie parcurgerea și promovarea disciplinei

Obiective generale: Însușirea atât din punct de vedere teoretic, cât și aplicativ a unor noțiuni fundamentale în teoria seriilor de timp, cum ar fi: staționaritate, trend, efect sezonier etc.

Rezultate așteptate ale învățării:

Cunoștințe	C1. Înțelege limbajul simbolic, formal și convențiile de exprimare în matematică. C4. Deține cunoștințe referitoare la metode matematice analitice avansate. C5. Înțelege fundamentele matematice pentru analiza relațiilor cantitative. C6. Dovedește cunoașterea metodelor avansate de lectură critică, analiză logică și sinteză a conținutului științific matematic. C7. Deține cunoștințe referitoare la metodologii și cadre conceptuale pentru identificarea și rezolvarea problemelor. C8. Înțelege și interpretează concepte abstracte în diverse contexte. C9. Înțelege metode de analiză, diagnostic și intervenție în rezolvarea de probleme complexe. C10. Deține cunoștințe cu privire la fundamentele teoretice și rezultatele avansate din diverse ramuri ale analizei matematice. C12. Deține cunoștințe referitoare la modelele probabilistice avansate și metodele statistice moderne utilizate în cercetarea cantitativă și analiza datelor. C13. Deține cunoștințe despre fundamentele teoretice ale analizei seriilor de timp și diverse modele matematice și statistice pentru descrierea și predicția fenomenelor dependente de timp. C17. Deține cunoștințe referitoare la modelele matematice și statistice specifice utilizate în industria asigurărilor și în evaluarea riscurilor. C21. Deține cunoștințe referitoare la fundamentele teoretice și algoritmi metode numerice pentru rezolvarea problemelor matematice, precum și principiile simulării numerice. C34. Înțelege principiile generale ale gestionării datelor de cercetare, inclusiv datele deschise.
------------	---

Abilități	A1. Selectează și aplică metode riguroase de cercetare pentru a investiga probleme matematice. A2. Utilizează simboluri și limbaj matematic pentru a prezenta idei și procese. A3. Redactează și explică raționamente matematice în formă riguroasă și clară. A4. Exemplifică noțiuni și concepte matematice prin mijloace adecvate. A5. Aplică metode matematice pentru a efectua analize complexe. A6. Concepe soluții bazate pe analiza matematică pentru probleme specifice. A7. Utilizează numere, simboluri și concepte matematice pentru a descrie relații. A8. Modelează și interpretează fenomene prin ecuații sau expresii matematice. A9. Elaborează reprezentări matematice riguroase ale relațiilor cantitative. A10. Utilizează concepte abstracte pentru a formula generalizări. A11. Corelează concepte matematice abstracte cu fenomene și aplicații concrete. A12. Analizează critic situații și formulează soluții inovative prin metode matematice și logice. A13. Optimizează strategiile de rezolvare în funcție de context și obiective. A14. Aplică metode analitice riguroase pentru a formula, analiza și rezolva probleme matematice complexe. A15. Integrează instrumente numerice în evaluarea ipotezelor științifice. A16. Execută investigații sistematice bazate pe măsurători și date numerice. A17. Utilizează tehnologii moderne pentru calcule avansate. A18. Aplică tehnici matematice pentru prelucrarea și organizarea datelor, pregătind seturile de date pentru analize statistice. A19. Selectează critic și implementează metode statistice avansate adecvate contextului științific, interpretând rezultatele pentru a susține concluziile cercetării. A20. Aplică metode computaționale și statistice pentru modelarea și analiza seriilor de timp. A28. Aplică modele matematice pentru a efectua analize cantitative ale riscurilor și a contribui la dezvoltarea de noi produse sau procese în sectorul financiar. A29. Implementează și utilizează metode numerice și simulări computaționale pentru a executa o investigație empirică sistematică sau a asista la cercetarea științifică. A30. Formulează și validează rezultate în cadrul unor investigații proprii. A33. Utilizează metode și tehnici științifice pentru a dezvolta concepte, modele sau tehnici noi. A34. Sintetizează observațiile empirice și datele colectate pentru a identifica pattern-uri. A71. Interpretează corect literatura de specialitate redactată în alte limbi. A80. Aplică standardele de integritate în utilizarea metodelor și tehnicilor științifice. A81. Investighează fenomenele respectând normele de conduită morală și profesională în știință.
-----------	--

Responsabilitate și autonomie	R1. Se angajează activ în generarea de cunoștințe noi prin investigație riguroasă. R2. Prioritizează sarcinile și organizează eficient activitatea pentru a soluționa problemele. R3. Examinează problemele teoretice cu rigoare și claritate conceptuală, identificând structuri fundamentale. R4. Bazează elaborarea teoriilor pe dovezi concrete, coerență logică, și pe cunoștințele acumulate de comunitatea științifică. R5. Contribuie la corectarea și integrarea cunoștințelor existente prin aplicarea metodelor științifice. R8. Asumă responsabilitatea pentru realizarea proiectului în conformitate cu cerințele de calitate. R23. Respectă și aplică practicile de codificare specifice comunității open source. R25. Respectă drepturile legale care protejează produsele ce fac obiectul drepturilor de proprietate intelectuală.
-------------------------------	--

7. Conținuturi

7.1 Curs	Metode de predare	Observații
Sisteme de variabile aleatoare (funcția de repartiție cumulativă, densitatea de probabilitate, media, varianța)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Serii de timp (definitie, generalitati, aplicabilitate, exemple)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Cateva concepte de baza in analiza seriilor de timp (stationaritate, trend, efect sezonier)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Modele clasice de descompunere	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Functia de autocorelatie. Proprietati. Teorema de caracterizare	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Previziune (tehnici de netezire exponentiala - modelul Holt-Winters)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Modele liniare (regresie)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Modele stochastice (mers aleator)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Modele autoregresive	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Modele ARMA (abordarea Box-Jenkins)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	

Modele heteroscedastice conditionale (ARCH, GARCH)	prelegerea, exemplificarea, demonstratia, dialogul	
Bibliografie: 1. A. Colojoara, Serii de Timp, Editura Universitatii din Bucuresti, 2007. 2. P.S.P. Cowpertwait, A.V. Metcalfe, Introductory Time Series with R, Springer Verlag, Dordrecht, Heidelberg, 2009. 3. M. Tertisco, P. Stoica, T. Popescu, Modelarea si Predictia Seriilor de Timp, Editura Academiei, Bucuresti, 1985. 4. R. Tsay, Analysis of financial time series, 3rd edition, Wiley, Chicago, 2010.		
7.2 Seminar / laborator	Metode de predare	Observații
R: Interfata Grafica RStudio	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Serii de timp (definitie, generalitati, aplicabilitate, exemple)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Cateva concepte de baza in analiza seriilor de timp (stationaritate, trend, efect sezonier)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele clasice de descompunere	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Functia de autocorelatie. Proprietati. Teorema de caracterizare	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Previziune (tehnici de netezire exponentiala - modelul Holt-Winters)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele liniare (regresie)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele stochastice (mers aleator)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele autoregresive	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele ARMA (abordarea Box-Jenkins)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Modele heteroscedastice conditionale (ARCH, GARCH)	exemplificarea, exercitiul, demonstratia, dialogul	
Bibliografie: 1. R.I. Kabacoff, R in action. Data analysis and graphics with R, Ed. a II-a, Manning Publications Co., Shelter Island, 2013, 475p (Ed. I, resursă electronică; https://www.manning.com/books/r-in-action?query=r%20in%20action%20first%20edition#toc) 2. E. Paradis, R pentru începători (resursă electronică; ftp://cran.r-project.org/pub/R/doc/contrib/Paradis-rdebuts_RO.pdf) 3. W.N. Venables, D.M. Smith and R Core Team, An Introduction to R (resursa electronică; https://cran.r-project.org/doc/manuals/r-release/R-intro.pdf).		

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

Conținutul disciplinei „Serii de timp cu aplicații” este similar cu cel al altor universități din țară, dar și din străinătate. Acest conținut urmează, pe scurt, structura unor cărți extrem de apreciate și folosite de comunitatea academică, cum ar fi cele ale lui P.S.P. Cowpertwait, A.V. Metcalfe, respectiv R. Tsay. Softul R este folosit, ca instrument de predare, în universități din întreaga lume. Utilitatea metodelor care fac obiectul acestui curs este binecunoscută, în special în cadrul instituțiilor financiare.

9. Evaluare

Tip activitate	9.1 Criterii de evaluare	9.2 Metode de evaluare	9.3 Pondere din nota finală
9.4 Curs	corectitudinea și completitudinea cunostintelor acumulare	evaluare scrisă / proiect	50%
	participarea activă la ore	evaluare scrisă	7.5%
9.5 Seminar / laborator	capacitatea de a aplica în practică cunostintele dobândite	test	30%
	abilitatea de a rezolva / prezenta probleme propuse	evaluare scrisă / orală	40%
	participarea activă la ore	evaluare orală	12.5%
9.6 Standard minim de performanță			
- prezența la cursuri și seminarii conform cerințelor generale ale facultății - cunoașterea noțiunilor fundamentale - însușirea principalelor metode de rezolvare a problemelor și utilizarea lor corectă			

Data completării
17/09/2024

Titular de disciplină
Conf. dr. Dan Popovici

Data avizării în departament
18/09/2024

Director de departament
Prof. dr. Bogdan Sasu