

## АННОТАЦИЯ

рабочей программы учебной дисциплины Б1.О.17 «Финансовая  
эконометрика»

Направление подготовки бакалавриат  
38.03.01 Экономика профиль – Налоги и налогообложение

1.	<p><b>Цель изучения дисциплины</b></p> <p>Цель курса «Финансовая эконометрика» состоит в том, чтобы сформировать теоретические и прикладные знания в области приложений экономико-статистических методов к решению профессиональных задач. Курс направлен на развитие аналитических и исследовательских навыков в области эконометрического исследования динамики активов на финансовых рынках, приложений для финансового анализа инвестиционных решений.</p>												
2.	<p><b>Место дисциплины в структуре ОПОП ВО бакалавриата</b></p> <p>Дисциплина относится к обязательным дисциплинам базовой части Б1.О.17</p> <p>Изучение данной дисциплины базируется на следующих дисциплинах:</p> <p>Математический анализ, Линейная алгебра, Теория вероятностей и математическая статистика, Макро-, микроэкономика.</p> <p>Основные положения дисциплины могут быть использованы при изучении следующих дисциплин: Финтех: инструментарий и модели бизнеса, Финансовые рынки, Статистика, Макроэкономическое планирование и прогнозирование.</p> <p>Дисциплина изучается в 4 семестре.</p>												
3.	<p><b>3. Результаты освоения дисциплины (модуля) Результаты освоения дисциплины (модуля)</b></p> <p>Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Код компетенции</th><th>Наименование компетенции</th><th>Индикатор достижения компетенции (закрепленный за дисциплиной)</th><th>В результате освоения дисциплины обучающийся должен:</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td rowspan="2">ОПК-2</td><td rowspan="2">Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач</td><td>ОПК-2.1 Проводит сбор, обработку и анализ данных для решения задач в области профессиональной деятельности</td><td> <p><b>Знать:</b> основные методы и средства получения, представления и обработки данных.</p> <p><b>Уметь:</b> анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей.</p> <p><b>Владеть:</b> современными и разнообразными инструментами и методами сбора и анализа обработки информации</p> </td></tr> <tr> <td>ОПК-2.2. Анализирует и интерпретирует показатели экономической деятельности;</td><td> <p><b>Знать:</b> систему показателей, позволяющую оценить результаты экономической деятельности.</p> <p><b>Уметь:</b> использовать источники экономической, социальной управленческой информации.</p> <p><b>Владеть:</b> основными навыками культуры мышления, готовностью к анализу, обобщению актуальной информации фактов теоретических положений.</p> </td></tr> </tbody> </table>			Код компетенции	Наименование компетенции	Индикатор достижения компетенции (закрепленный за дисциплиной)	В результате освоения дисциплины обучающийся должен:	ОПК-2	Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач	ОПК-2.1 Проводит сбор, обработку и анализ данных для решения задач в области профессиональной деятельности	<p><b>Знать:</b> основные методы и средства получения, представления и обработки данных.</p> <p><b>Уметь:</b> анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей.</p> <p><b>Владеть:</b> современными и разнообразными инструментами и методами сбора и анализа обработки информации</p>	ОПК-2.2. Анализирует и интерпретирует показатели экономической деятельности;	<p><b>Знать:</b> систему показателей, позволяющую оценить результаты экономической деятельности.</p> <p><b>Уметь:</b> использовать источники экономической, социальной управленческой информации.</p> <p><b>Владеть:</b> основными навыками культуры мышления, готовностью к анализу, обобщению актуальной информации фактов теоретических положений.</p>
Код компетенции	Наименование компетенции	Индикатор достижения компетенции (закрепленный за дисциплиной)	В результате освоения дисциплины обучающийся должен:										
ОПК-2	Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач	ОПК-2.1 Проводит сбор, обработку и анализ данных для решения задач в области профессиональной деятельности	<p><b>Знать:</b> основные методы и средства получения, представления и обработки данных.</p> <p><b>Уметь:</b> анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей.</p> <p><b>Владеть:</b> современными и разнообразными инструментами и методами сбора и анализа обработки информации</p>										
		ОПК-2.2. Анализирует и интерпретирует показатели экономической деятельности;	<p><b>Знать:</b> систему показателей, позволяющую оценить результаты экономической деятельности.</p> <p><b>Уметь:</b> использовать источники экономической, социальной управленческой информации.</p> <p><b>Владеть:</b> основными навыками культуры мышления, готовностью к анализу, обобщению актуальной информации фактов теоретических положений.</p>										

	ОПК-3	Способен анализировать и содержательно объяснять природу экономических процессов на микро- и макроуровне	ОПК-3.И-1 Анализирует и содержательно объясняет события мировой и отечественной экономической истории	<b>Знать:</b> сущность и особенности современных экономических процессов, характеристики и показатели их взаимосвязи; <b>Уметь:</b> выбрать наиболее подходящую, соответствующую решаемой задаче спецификацию эконометрической модели; выявлять сущность и особенности современных экономических процессов, их связь с другими процессами, происходящими в обществе
			ОПК-3.И-2 Анализирует и содержательно объясняет текущие процессы, происходящие в мировой и отечественной экономике	<b>Знать:</b> методы математических постановок финансово-экономических задач для анализа исходных данных.  <b>Уметь:</b> использовать методы математических постановок финансово-экономических задач для анализа исходных данных

Структура и содержание дисциплины							
4.1. Структура дисциплины (модуля)							
4.	Вид учебной работы	3	Прядковый номер семестра				
			4				
	Общая трудоемкость дисциплины всего (в з.е.), в том числе:	3 з.е.					
	Курсовой проект (работа)	не предусмотрено					
	Аудиторные занятия всего (вакад. часах), в том числе:	50	50				
	Лекции	34	34				
	Практические занятия, семинары	16	16				
	Лабораторные работы						
	Самостоятельная работа всего (вакад. часах), в том числе:	58	58				
	КСР						
	Экзамен						
	Общая трудоемкость дисциплины	108	108				
ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА							
Аудиторные занятия всего (вакад. часах), в том числе:	16	16					
Лекции	16	16					
Практические занятия, семинары							
Лабораторные работы							

Общая трудоемкость работ всего (вакад. часах), в том числе:		76	76				
КСР							
Экзамен							
Общая трудоемкость дисциплины		108	108				
<b>4.2. Содержание дисциплины</b>							

## 4.2. Содержание дисциплины (модуля)

№ п/	Наименование раздела дисциплины	Содержание
<i>Содержание лекционного курса</i>		
1	Экономическое моделирование	Предмет и содержание курса «Эконометрика». Некоторые сведения об истории возникновения эконометрики. Становление эконометрики. Задачи эконометрики в области социально-экономических исследований. Понятие эконометрической модели. Основные этапы построения эконометрического моделирования. Классификация переменных в эконометрических моделях.
2	Линейные и нелинейные модели парной регрессии.	Спецификация модели: уравнение простой регрессии, понятие случайной величины; ошибки спецификации измерения; основные типы кривых, используемые для количественной оценки связей между двумя переменными. Линейная регрессия и корреляция:
3	Линейная модель множественной регрессии	Обобщенная линейная модель множественной регрессии (ОЛММР). Подбор факторов множественной регрессии. Оценка параметров и их значимости уравнения множественной регрессии. Точечный и интервальный прогноз по уравнению регрессии. Фиктивные переменные.
4	Временные ряды и прогнозирование	Временной ряд как выборочная совокупность из бесконечного ряда значений показателей во времени. Уровни временного ряда. Моментный временной ряд. Интервальный ряд. Производный временной ряд. Цели анализа временных рядов. Прогнозирование. Идентификация модели временного ряда. Компоненты временного ряда.
5	Методы анализа временных рядов для моделирования динамики доходностей	Особенности финансовых временных рядов. Риск-нейтральность. Доходностей. Коэффициенты эксцесса и асимметрии. Проверка гипотезы нормальности. Тест Jarque-Berra. Гипотеза эффективности рынков. Формы рыночной эффективности. Использование регрессионного анализа для предсказания доходностей и проверки гипотезы эффективности рынков. Линейные модели временных рядов и процедуры оценивания. Эмпирические результаты тестирования моделей. Методы оценивания точности прогнозирования.



5.	<b>Образовательные технологии</b> При подготовке бакалавров-биологов используются следующие основные формы проведения учебных занятий: <ul style="list-style-type: none"><li>• интерактивные лекции;</li><li>• лекции-пресс-конференции;</li><li>• тренинги и семинары по развитию профессиональных навыков;</li><li>• групповые, научные дискуссии, дебаты.</li></ul>
6.	<b>Используемые ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Internet»; информационные технологии, программные средства и информационно-справочные системы</b> <b>Информационное обеспечение баз данных, информационно-справочные и поисковые системы</b> 1. <a href="http://ru.wikipedia.org/wiki/3">http://ru.wikipedia.org/wiki/3</a> . <a href="http://elibrary.ru/">http://elibrary.ru/</a> 4. <a href="http://www.iprbookshop.ru/5.htm">http://www.iprbookshop.ru/5.htm</a> <a href="http://window.edu.ru">http://window.edu.ru</a> 6. <a href="http://school-collection.edu.ru">http://school-collection.edu.ru</a> 7. <a href="http://www.edu.ru">http://www.edu.ru</a> 8. <a href="http://www.studentlibrary.ru">http://www.studentlibrary.ru</a> 9. <a href="http://rvb.ru">http://rvb.ru</a> 10. <a href="http://e.lanbook.com">http://e.lanbook.com</a> 11. <a href="http://old.rsue.ru/Academy/Archives/Index.htm">http://old.rsue.ru/Academy/Archives/Index.htm</a> 12. <a href="http://elibrary.ru/defaultx.asp">http://elibrary.ru/defaultx.asp</a> 13. <a href="http://www.informio.ru">http://www.informio.ru</a> 14. <a href="https://www.biblio-online.ru">https://www.biblio-online.ru</a>
7.	<b>Формы текущего контроля</b> Коллоквиумы по разделам дисциплины
8.	<b>Форма промежуточного контроля</b> Зачет

Разработчик: ст. преподаватель кафедры Цифровой и отраслевой экономики Погорова З.М.