

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Петровская Анна Викторовна

Должность: Директор

Дата подписания: 20.10.2022 15:34:22

Уникальный программный ключ:

798bda6555fbdebe827768f6f1710bd17a9b70c11dc156aba5a1104c91d9

Приложение 3

к основной профессиональной образовательной программе

по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

направленность (профиль) программы магистратуры Финансовая аналитика

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»
Краснодарский филиал РЭУ им. Г.В. Плеханова**

**Факультет экономики, менеджмента и торговли
Кафедра бухгалтерского учета и анализа**

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.04 ФИНАНСОВАЯ ЭКОНОМЕТРИКА

Направление подготовки 38 .04 .08 Финансы и кредит

Направленность (профиль) программы «Финансовая аналитика»

Уровень высшего образования *Магистратура*

Год начала подготовки 2021 Г.

Краснодар – 2021 г.

Составитель:

к.т.н., доцент, доцент кафедры
бухгалтерского учета и анализа

И.Н. Булатникова

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры бухгалтерского учета и анализа
Краснодарского филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова,
протокол от 28.01.2021 № 6

СОДЕРЖАНИЕ

I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ.....	4
Цель и задачи освоения дисциплины	4
Место дисциплины в структуре образовательной программы	4
Объем дисциплины и виды учебной работы.....	4
Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине	5
II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	7
III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	10
РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА	10
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ.....	10
ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ	10
ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ	11
ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	11
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ.....	11
МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	11
IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ	11
V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ	12
VI. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ	13
ПРИЛОЖЕНИЕ 1	21

I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

Цель и задачи освоения дисциплины

Цель изучения дисциплины «Финансовая эконометрика» является: формирование у будущих специалистов научного представления о методах, моделях и приемах, позволяющих сопоставлять количественные выражения закономерностям экономической теории на базе экономической статистики с использованием математико-статистического инструментария.

Задачи освоения дисциплины

- рассмотреть методы оценки, прогноза и имитации экономических и социально-экономических показателей, характеризующих состояние и развитие экономических систем финансовой сферы;
- охарактеризовать навыки практического применения современных инструментальных методов, технологий сбора, обработки, критической оценки финансовой информации, продвинутых методов экономического и финансового анализа, в том числе с использованием интеллектуально-аналитических систем в процессе проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований при решении профессиональных задач в сфере финансов;
- объяснить навыки использования моделей прогнозирования и финансового моделирования, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Финансовая эконометрика» относится к обязательной части учебного плана.

Объем дисциплины и виды учебной работы

Таблица 1

Показатели объема дисциплины	Всего часов по формам обучения		
	очная	очно-заочная	заочная
Объем дисциплины в зачетных единицах	3 ЗЕТ		
Объем дисциплины в акад. часах	108		
Промежуточная аттестация: форма	зачет	зачет	зачет
Контактная работа обучающихся с преподавателем (Контакт. часы), всего:	18	16	8
1. Аудиторная работа (Ауд.), акад. часов всего, в том числе:	16	14	6
- лекции	6	4	2
- практические занятия	10	10	4
- лабораторные занятия	-	-	-
в том числе практическая подготовка	-	-	-
2. Индивидуальные консультации (ИК)	-	-	-
3. Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)	2	2	2
4. Консультация перед экзаменом (КЭ)	-	-	-
5. Контактная работа по промежуточной аттестации в период экз. сессии / сессии заочников (Каттэк)	-	-	-
Самостоятельная работа (СР), всего:	90	92	100
в том числе:			

• самостоятельная работа в период экз. сессии (СРЭК)	-	-	2
• самостоятельная работа в семестре (СРС)	90	92	98
в том числе, самостоятельная работа на курсовую работу (заполняется при наличии по дисциплине курсовых работ/проектов)	-	-	-
• расчетно-аналитические задания	30	32	38
• подготовка к опросу	30	30	30
• выполнение индивидуального или группового проекта	-	-	-
• и другие виды:	30	30	30
• подготовка докладов	30	30	30

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

Таблица 2

Формируемые компетенции (код и наименование компетенции)	Индикаторы достижения компетенций (код и наименование индикатора)	Результаты обучения (знания, умения)
ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем	ОПК-2.1. Применяет современные инструментальные методы, технологии сбора, обработки, критической оценки финансовой информации, продвинутое методы экономического и финансового анализа, в том числе с использованием интеллектуально-аналитических систем в процессе проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований при решении профессиональных задач в сфере финансов	ОПК-2.1. 3-1. Знает продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа для решения задач в области финансовых исследований; современные виды интеллектуальных информационно-аналитических систем. ОПК-2.1. 3-2. Знает современные инструментальные методы получения, обработки экономической и финансовой информации; технические средства сбора финансовых данных, инструментальные методы их обработки и анализа для проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований в сфере финансов. ОПК-2.1. 3-3. Знает современные методы анализа финансовой, управленческой и бюджетной отчетности; методы проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований в области финансовых отношений; принципы разработки моделей стратегического и оперативного финансового планирования.

		<p>ОПК-2.1. У-1. Умеет выбирать и использовать инструментальные средства, современное программное обеспечение для систематизации и анализа экономической и финансовой информации; работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах в сфере финансов, в т.ч. продвинутые методы экономического и финансового анализа.</p> <p>ОПК-2.1. У-2. Умеет анализировать большие массивы финансовых и экономических данных, используя технологии интеллектуальных информационно-аналитических систем, финансовые проблемы и процессы, происходящие на микро-, мезо- и макроуровнях и прогнозировать возможное их развитие в будущем.</p> <p>ОПК-2.1. У-3. Умеет интерпретировать результаты финансовых расчетов и формировать обоснованные экспертные заключения для принятия управленческих решений в сфере финансов.</p>
	<p>ОПК-2.2. Использует модели прогнозирования и финансового моделирования, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга</p>	<p>ОПК-2.2. У-1. Знает современные методы прогнозирования и планирования, принципы финансового моделирования для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга.</p> <p>ОПК-2.2. З-1. Умеет разрабатывать, обосновывать и защищать бизнес-планы, проектные решения в сфере финансового консалтинга и оценочной деятельности</p>

II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ
этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций

Таблица 3

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины	Трудоемкость, академические часы						Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения (знания, умения)	Учебные задания для аудиторных занятий	Текущий контроль	Задания для творческого рейтинга
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа	Всего					
Семестр 1												
Раздел 1. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ												
1.	Тема 1. Классическая линейная модель множественной регрессии	2	2	-	-	18	22	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
2.	Тема 2. Различные типы моделей регрессии	2	2	-	-	18	22	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
3.	Тема 3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии	0	2	-	-	18	20	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 2. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ												
4.	Тема 4. Временные ряды	0	2	-	-	18	20	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 3 ОДНОМЕРНЫЕ УРАВНЕНИЯ И ИХ СИСТЕМЫ												
	Тема 5. Системы линейных эконометрических уравнений	2	2			18	22	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
	Итого	6	10	-	-	90	106					

Очная-заочная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины	Трудоемкость, академические часы						Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения (знания, умения)	Учебные задания для аудиторных занятий	Текущий контроль	Задания для творческого рейтинга
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа	Всего					
Семестр 2												
Раздел 1. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ												
1.	Тема 1. Классическая линейная модель множественной регрессии.	-	2	-	-	18	20	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
2.	Тема 2. Различные типы моделей регрессии.	2	2	-	-	18	22	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
3.	Тема 3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии.	-	2	-	-	18	20	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 2. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ												
4.	Тема 4. Временные ряды.	-	2	-	-	18	20	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 3 ОДНОМЕРНЫЕ УРАВНЕНИЯ И ИХ СИСТЕМЫ												
5.	Тема 5. Системы линейных эконометрических уравнений.	2	2			20	24	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
	Итого	4	10	-	-	92	106					

Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины	Трудоемкость, академические часы						Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения (знания, умения)	Учебные задания для аудиторных	Текущий контроль	Задания для творческого
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа	Всего					
Семестр 2 (курс 1)												
Раздел 1. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ												
1.	Тема 1. Классическая линейная модель множественной регрессии	-	1	-	-	20	21	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
2.	Тема 2. Различные типы моделей регрессии	0,5	0,5	-	-	20	21	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
3.	Тема 3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии	0,5	0,5	-	-	20	21	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 2. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ												
4.	Тема 4. Временные ряды	0,5	1	-	-	20	21,5	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
Раздел 3 ОДНОМЕРНЫЕ УРАВНЕНИЯ И ИХ СИСТЕМЫ												
5.	Тема 5. Системы линейных эконометрических уравнений	0,5	1			20	21,5	ОПК-2.1 ОПК-2.2	ОПК-2.1, 3-1,3-2,3-3 ОПК-2.1.У-1,У-2,У-3 ОПК-2.2, 3-1, У-1.	О	Р.а.з.	Д
	Итого	2	4	-	-	100	106					

Формы учебных заданий на аудиторных занятиях: *Опрос (О.)*

Формы текущего контроля: *Расчетно-аналитические задания или иные задания и задачи (р.а.з.)*

Формы заданий для творческого рейтинга: *доклад (Д.)*

III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Новиков, А. И. Эконометрика [Электронный ресурс] : Учебное пособие / А. И. Новиков. - М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. - 224 с. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=415339>
2. Уткин, В. Б. Эконометрика [Электронный ресурс]: Учебник / В. Б. Уткин; Под ред. проф. В. Б. Уткина. - 2-е изд. - М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. – 564 с. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=415317>
3. Елисеева И.И. Эконометрика : учебник для бакалавриата и магистратуры / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2017. — 449 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/398742>, <https://biblio-online.ru/viewer/ekonometrika-398742#page/1>

Дополнительная литература:

1. Айвазян С.А. Эконометрика - 2: продвинутый курс с приложениями в финансах: Учеб. / С.А. Айвазян, Д. Фантацини; Московская школа экономики МГУ им. М.В. Ломоносова (МШЭ) - М.: Магистр: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 944 с. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=472607>
2. Бородич С. А. Эконометрика. Практикум: Учебное пособие / С.А. Бородич - М.: НИЦ ИНФРА-М, Нов. знание, 2015. - 329 с.: Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=502332>
3. Галочкин, В. Т. Эконометрика : учебник и практикум для бакалавриата и специалитета / В. Т. Галочкин. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 288 с. — (Бакалавр и специалист). — ISBN 978-5-534-10751-7. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт - Режим доступа: <https://biblio-online.ru/viewer/ekonometrika-431440#page/1>
4. Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебное пособие для академического бакалавриата / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2017. — 186 с. — (Бакалавр и специалист). — ISBN 978-5-534-04565-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/406926>, <https://biblio-online.ru/viewer/ekonometrika-406926#page/1>
5. Крянев А.В. Эконометрика (продвинутый уровень): / Крянев А.В. - М.:КУРС, НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 62 с. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=767248>

Нормативно-правовые документы:

В рамках изучения дисциплины не используются.

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ

1. <http://www.consultant.ru> – Справочно-правовая система Консультант Плюс;
2. <http://www.garant.ru> – Справочно-правовая система Гарант.

ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ

- 1, ЭБС «ИНФРА–М» <http://znanium.com>
2. Научная электронная библиотека elibrary.ru <https://elibrary.ru/>
3. ЭБС ВООК.ru <http://www.book.ru>
4. ЭБС «Лань» <https://e.lanbook.com/>
5. ЭБС «ЮРАЙТ» <https://biblio-online.ru/>
6. Университетская библиотека online <http://biblioclub.ru/>

7. ЭБС «Grebennikon <https://grebennikon.ru/>

8. Видеолекции НПП Краснодарского филиала <http://vrgteu.ru/course/view.php?id=6680>

ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ

1. www.gks.ru – Сайт Федеральной службы государственной статистики РФ.
2. www.worldbank.org Сайт – Всемирного Банка Реконструкции и Развития.
3. stat.hse.ru – Базы данных экономической статистики РФ.
4. www.budget.ru – Финансовое казначейство РФ
5. www.gks.ru – Федеральная служба государственной статистики РФ.
6. www.minfin.ru – Министерство финансов РФ
7. www.cbr.ru – Центральный Банк Российской Федерации Макроэкономическая статистика
8. <http://quote.rbc.ru/shares/> – Курсы акций, облигаций, валют и т.п.
9. <http://www.forex.ru/index.html> – Форекс.
10. <http://www.rts.ru/> – Биржа РТС.
11. www.micex.ru/ – Биржа ММВБ.

ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. www.economy.gov.ru – Сайт Министерства экономического развития и торговли РФ.
1. <http://www.rbc.ru> – Официальный сайт АО «РОСБИЗНЕСКОНСАЛТИНГ»

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ

1. Операционная система Windows 10, Microsoft Office Professional Plus: 2019 год (MS Word, MS Excel, MS Power Point, MS Access).
2. Браузер Google Chrome.

МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «*Финансовая эконометрика*» обеспечена:

для проведения занятий лекционного типа:

- учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью, мультимедийными средствами обучения для демонстрации лекций-презентаций;

для проведения занятий семинарского типа (*практические занятия*):

- учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации: ноутбук, проектор;
- компьютерным классом;
для самостоятельной работы, в том числе для курсового проектирования:
- помещением для самостоятельной работы, оснащенным компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде университета.

IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

- Методические рекомендации по организации и выполнению внеаудиторной самостоятельной работы.
- Методические указания по подготовке и оформлению рефератов.

V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Оценивание результатов обучения по дисциплине для студентов очной, заочной и очно-заочной формы обучения по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, направленность (профиль) программы магистратуры «Финансовая аналитика» проводится с помощью шкал оценки по видам оценочных средств, формам текущего контроля и промежуточной аттестации.

Оценивание результатов контроля осуществляется по традиционной четырехбалльной шкале согласно следующим критериям.

Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания представлено в разделе II «Содержание программы учебной дисциплины» и разделе V настоящей рабочей программы.

Формы проведения текущего контроля представлены в таблице 4

Таблица 4

Вид оценочного средства	Форма текущего контроля успеваемости	Шкала оценки
<i>1. Тесты по разделу дисциплины</i>	<i>Тестирование письменное или с использованием программных средств на практическом занятии</i>	<i>100-процентная</i>
<i>2. Вопросы для проведения устного опроса по разделу дисциплины</i>	<i>Письменный либо устный опрос на практическом занятии</i>	<i>Четырехбалльная</i>
<i>3. Индивидуальные темы докладов по заданной тематике</i>	<i>Устный доклад на практическом занятии и его обсуждение</i>	<i>Четырехбалльная</i>
<i>4. Дискуссионные темы для проведения полемики</i>	<i>Обсуждение заданной проблемы и спорных вопросов по разделу дисциплины на практическом занятии</i>	<i>Четырехбалльная</i>
<i>5. Описание различных производственных ситуаций (кейсы)</i>	<i>Решение ситуационных задач на практическом занятии</i>	<i>Четырехбалльная</i>
<i>6. Вопросы к контрольной работе</i>	<i>Выполнение контрольной работы</i>	<i>Двухбалльная</i>

Каждая шкала оценки включает критерии, на основе которых выставляются оценки при проведении текущего контроля

Шкала оценки	Оценка	Критерий выставления оценки
100-процентная	отлично	<i>85-100 % правильных ответов</i>
	хорошо	<i>65-84 % правильных ответов</i>
	удовлетворительно	<i>40-64 % правильных ответов</i>
	неудовлетворительно	<i>менее 40 % правильных ответов</i>
двухбалльная	зачтено	<i>выполнено</i>
	незачтено	<i>не выполнено</i>
четырехбалльная	отлично	<i>Студент глубоко и прочно усвоил весь программный материал, исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно его излагает, тесно увязывает теорию с практикой. Студент не затрудняется с ответом при видоизменении задания, свободно справляется с задачами, заданиями и другими видами применения знаний, показывает знания законодательного и нормативного материала, правильно обосновывает принятые решения, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ, обнаруживает умение</i>

		<i>самостоятельно обобщать и излагать материал, не допуская ошибок</i>
	хорошо	<i>Студент твердо знает программный материал, грамотно и по существу излагает его, не допускает существенных неточностей в ответе на вопрос, может правильно применять теоретические положения и владеет необходимыми навыками при выполнении практических заданий</i>
	удовлетворительно	<i>Студент усвоил только основной материал, но не знает отдельных деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушает последовательность в изложении программного материала и испытывает затруднения в выполнении практических заданий</i>
	неудовлетворительно	<i>Студент не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, с большими затруднениями выполняет практические работы.</i>

VI. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Оценочные средства по дисциплине разработаны в соответствии с Положением о фонде оценочных средств в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова».

Тематика курсовых работ/проектов

Курсовая работа/проект по дисциплине «Финансовая эконометрика» учебным планом не предусмотрена.

Типовой перечень вопросов к зачету:

Номер вопроса	Перечень вопросов к зачету
1	Понятие эконометрики. Связь эконометрики с другими областями знаний.
2	Эконометрическая модель – главный инструмент эконометрических исследований. Задачи, решаемые на её основе.
3	Этапы эконометрического исследования.
4	Типы данных и виды переменных в эконометрических исследованиях.
5	Классификация эконометрических методов.
6	Компьютерные программы в практике эконометрических исследований. Сравнительный анализ компьютерных программ. Выбор программ для практической работы
7	Двумерная (однофакторная) регрессионная модель.
8	Нормальная линейная регрессионная модель с одной переменной.
9	Традиционный метод наименьших квадратов – МНК (OLS).
10	Оценка дисперсии случайной составляющей. Статистические свойства МНК-оценок: состоятельность, несмещенность, эффективность.
11	Теорема Гаусса-Маркова.
12	Показатели качества регрессии.
13	Проверка качества регрессии. F-критерий Фишера.

14	Проверка гипотез о значимости параметров регрессии, коэффициента корреляции и уравнения регрессии в целом. t-критерий Стьюдента.
15	Прогноз ожидаемого значения резульативного признака по линейному парному уравнению регрессии.
16	Интервальная оценка функции регрессии и ее параметров.
17	Нелинейная регрессия. Виды нелинейной регрессии.
18	Нелинейные модели регрессии и их линеаризация.
19	Нелинейные модели относительно включенных в анализ объясняющих переменных.
20	Регрессионные модели, нелинейные по оцениваемым параметрам.
21	Коэффициент эластичности.
22	Индекс корреляции. Индекс детерминации
23	Нормальная линейная модель множественной регрессии.
24	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками.
25	Мультиколлинеарность факторных переменных. Причины, методы измерения и устранения мультиколлинеарности.
26	Отбор факторов, включаемых в модель множественной регрессии.
27	Традиционный метод наименьших квадратов для многомерной регрессии (OLS)
28	Обобщенный метод наименьших квадратов. (ОМНК) для множественной регрессии.
29	Показатели тесноты связи фактора с результатом: коэффициенты частной эластичности.
30	Показатели тесноты связи фактора с результатом: стандартизованные коэффициенты регрессии.
31	Частная корреляция.
32	Коэффициенты множественной детерминации и корреляции.
33	Скорректированный коэффициент множественной детерминации.
34	Оценка значимости уравнения множественной регрессии.
35	Оценка значимости фактора, дополнительно включенного в модель регрессии. Частный F-критерий Фишера.
36	Фиктивные переменные множественной регрессии. Модели с фиктивными переменными.
37	Тест Чоу.
37	Нелинейная множественная регрессия.
38	Гетероскедастичность случайной составляющей. Графический анализ остатков на обнаружение гетероскедастичности.
39	Тест ранговой корреляции Спирмена.
40	Тест Парка.
41	Тест Глейзера.
42	Тест Голдфелда-Квандта.
43	Метод взвешенных наименьших квадратов.
44	Автокорреляция случайных составляющих. Обнаружение автокорреляции случайных составляющих.
45	Графический метод обнаружения автокорреляции.
46	Метод рядов обнаружения автокорреляции.
47	Критерий Дарбина—Уотсона.
48	Устранение автокорреляции случайных составляющих.
49	Стохастические объясняющие переменные.

50	Обнаружение корреляции объясняющих переменных и случайной составляющей.
51	Понятие и характеристики временных рядов.
52	Модели стационарных временных рядов и их идентификация.
53	Модели нестационарных временных рядов.
54	Прогнозирование, основанное на использовании моделей временных рядов.
55	Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры.
56	Моделирование тенденции временного ряда (построение тренда).
57	Моделирование сезонных и циклических колебаний.
58	Специфика изучения взаимосвязей по временным рядам. Исключение сезонных колебаний.
59	Специфика изучения взаимосвязей по временным рядам. Исключение тенденции.
60	Модели с распределённым лагом. Интерпретация параметров.
61	Средний и медианный лаги. Изучение структуры лагов
62	Оценивание параметров моделей с распределённым лагом. Метод Алмон.
63	Оценивание параметров моделей с геометрической структурой лага. Метод Койка.
64	Авторегрессионные динамические модели.

Типовые расчетно-аналитические задания/задачи:

Тема 1. Классическая линейная модель множественной регрессии

Задача 1. По 30 различным предприятиям края собраны статистические данные за прошедший год о доле прибыли, направленной для выплаты дивидендов по своим акциям, и объеме средств (млн. руб.), выделенных на развитие производства.

№ предприятия	Прибыль для выплаты дивидендов по акциям, %	Объем средств, направленных на развитие производства, млн. руб.
1	11,9	17,6
2	16,3	11,4
3	9,1	33,4
4	11,4	29,6
5	13,4	15,5
6	21,7	10,0
7	18,3	19,3
8	15,5	6,0
9	16,8	28,3
10	12,0	21,5
11	19,3	11,7
12	13,6	23,5
13	15,0	17,7
14	14,0	27,0
15	17,1	14,9
16	8,7	25,5
17	16,6	17,4
18	15,3	24,6
19	16,2	20,4
20	18,6	27,4
21	15,7	12,0
22	14,4	29,6
23	16,0	36,0

№ предприятия	Прибыль для выплаты дивидендов по акциям, %	Объем средств, направленных на развитие производства, млн. руб.
24	18,2	13,1
25	17,2	31,8
26	10,8	35,5
27	18,0	10,7
28	11,5	12,3
29	9,7	11,7
30	20,4	10,6

Необходимо:

- 1) Получить интервальный ряд, характеризующий распределение предприятий по сумме средств, направленных на развитие производства, образцов пять групп с равными интервалами;
- 2) Построить корреляционную таблицу и аналитическую группировку для изучения связи между процентом прибыли для выплаты дивидендов по акциям и объемом средств, направленных на развитие производства.

Тема 2. Различные типы моделей регрессии

Задача 1. По территориям региона приводятся данные за 2014 г.

Требуется:

1. Построить линейное уравнение парной регрессии y от x .
2. Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции и среднюю ошибку аппроксимации.
3. Оценить статистическую значимость параметров регрессии и корреляции с помощью F -критерия Фишера.
4. На одном графике построить исходные данные и теоретическую прямую.

Номер региона	Среднедушевой прожиточный минимум в день одного трудоспособного, руб., x	Среднедневная заработная плата, руб., y
1	81	124
2	77	131
3	85	146
4	79	139
5	93	143
6	100	159
7	72	135
8	90	152
9	71	127
10	89	154
11	82	127
12	111	162

Тема 3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии.

Задача 1. По группе предприятий, производящих однородную продукцию, известно, как зависит себестоимость единицы продукции y от факторов, приведенных в таблице.

Определите с помощью коэффициентов эластичности силу влияния каждого фактора на результат. Проранжируйте факторы по силе влияния, сделайте вывод.

Признак-фактор	Уравнение парной регрессии	Среднее значение признака
----------------	----------------------------	---------------------------

Трудоемкость единицы продукции, чел.-час., x_1	$Y_{x_1} = 9,3 + 9,83x_1$	1,38
Объем производства, млн.ден.ед., x_2	$Y_{x_2} = 0,62 + \frac{58.47}{x_2}$	2,64
Цена за одну тонну энергоносителя, млн.ден.ед., x_3	$Y_{x_3} = 11,73x_3^{1,6281}$	1,503
Доля прибыли, изымаемой государством, %, x_4	$Y_{x_4} = 14,87 \cdot 1,016^{x_4}$	26,3

Тема 4. Временные ряды

Задача 1. Имеются следующие данные о среднем размере товарных запасов в универмаге по месяцам года, млн. руб.:

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
21,2	21,3	21,2	21,3	21,2	21,0	21,0	20,2	19,2	20,1	20,8	21,1

Произведите сглаживание ряда товарных запасов универмага методом скользящей средней с шириной окна $m=4$. Сделайте выводы о характере общей тенденции изучаемого явления.

Задача 2. Уровень временного ряда (y_t) описывается мультипликативной моделью. Установлено, что периодичность временного ряда составляет $\tau=4$, получены значения сезонных компонент: $S_1 = 2,087$; $S_2 = 0,632$; $S_3 = 0,931$; $S_4 = 3,256$. Модель тренда получена в виде $T=3,14+2,07*t$. Рассчитать модельное значение временного ряда для 6-го показателя $t=6$ или $y(6)$.

Задача 3. Уровень временного ряда (y_t) описывается аддитивной моделью. Установлено, что периодичность временного ряда составляет $\tau=3$, получены значения сезонных компонент: $S_1 = 1,7$; $S_2 = -0,9$; $S_3 = 0,1$. Модель тренда получена в виде $T=0,3+1,8*t$. Рассчитать модельное значение временного ряда для 4-го показателя $t=4$ или $y(4)$.

Тема 5. Системы линейных эконометрических уравнений

Задача 1. По данным о величине совокупного объема инвестиций Y и ВВП США X за период с 1939 по 1954 г. оцените насколько сказались военные действия в Европе в период 1942—1945 гг. на объеме внутренних инвестиций. Изменился ли характер зависимости объемов внутренних инвестиций от ВВП в годы войны?

Годы	1939	1940	1941	1942	1943	1944	1945	1946
Y	9,3	13,1	17,9	9,9	5,8	7,2	10,6	30,7
X	90,8	100,0	124,9	158,3	192,0	210,5	212,3	209,3
Годы	1947	1948	1949	1950	1951	1952	1953	1954
Y	34,0	45,9	35,3	53,8	59,2	52,1	53,3	52,7
X	232,8	259,1	258,0	286,2	330,2	347,2	366,1	366,3

Тематика докладов:

1. История зарождения эконометрики как науки. Основоположники. Классические линейные регрессионные модели и основные этапы их анализа в эконометрике.

2. Модели нелинейной регрессии, нелинейные по параметрам. Модели нелинейной регрессии, нелинейные по переменным.
3. Метод наименьших квадратов (различные модели).
4. Фиктивные переменные в регрессионном анализе.
5. Прогнозирование, основанное на использовании моделей временных рядов. Моделирование тенденции временного ряда (построение тренда).

Типовая структура зачетного задания

<i>Наименование оценочного средства</i>
<i>Вопрос 1</i>
<i>Вопрос 2</i>
<i>Практическое задание (расчетно-аналитическое) 1</i>
<i>Практическое задание (расчетно-аналитическое) 2</i>

Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания

Таблица 4

Шкала оценивания	Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
«зачтено»	<p>ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем</p>	<p>ОПК-2.1. Применяет современные инструментальные методы, технологии сбора, обработки, критической оценки финансовой информации, продвинутое методы экономического и финансового анализа, в том числе с использованием интеллектуально-аналитических систем в процессе проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований при решении профессиональных задач в сфере финансов</p> <p>ОПК-2.2. Использует модели прогнозирования и финансового моделирования, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга</p>	<p>Знает на базовом уровне, с ошибками: современные инструментальные методы получения, обработки экономической и финансовой информации; технические средства сбора финансовых данных, инструментальные методы их обработки и анализа для проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований в сфере финансов; современные методы прогнозирования и планирования, принципы финансового моделирования для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга.</p> <p>Умеет на базовом уровне, с ошибками: выбирать и использовать инструментальные средства, современное программное обеспечение для систематизации и анализа экономической и финансовой информации; работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах в сфере финансов, в т.ч. продвинутое методы экономического и финансового анализа; разрабатывать, обосновывать и защищать бизнес-планы, проектные решения в сфере финансового консалтинга и оценочной деятельности.</p>	Базовый

	«не зачтено»	<p>ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем</p>	<p>ОПК-2.1. Применяет современные инструментальные методы, технологии сбора, обработки, критической оценки финансовой информации, продвинутое методы экономического и финансового анализа, в том числе с использованием интеллектуально-аналитических систем в процессе проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований при решении профессиональных задач в сфере финансов</p> <p>ОПК-2.2. Использует модели прогнозирования и финансового моделирования, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга</p>	<p>Не знает на базовом уровне: современные инструментальные методы получения, обработки экономической и финансовой информации; технические средства сбора финансовых данных, инструментальные методы их обработки и анализа для проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований в сфере финансов; современные методы прогнозирования и планирования, принципы финансового моделирования для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга.</p> <p>Не умеет на базовом уровне: выбирать и использовать инструментальные средства, современное программное обеспечение для систематизации и анализа экономической и финансовой информации; работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах в сфере финансов, в т.ч. продвинутое методы экономического и финансового анализа; разрабатывать, обосновывать и защищать бизнес-планы, проектные решения в сфере финансового консалтинга и оценочной деятельности.</p>	<p>Компетенции не сформированы</p>
--	-----------------	--	---	--	---

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Российский экономический университет имени Г. В. Плеханова»
Краснодарский филиал РЭУ им. Г. В. Плеханова**

Факультет экономики, менеджмента и торговли

Кафедра бухгалтерского учета и анализа

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.04 ФИНАНСОВАЯ ЭКОНОМЕТРИКА

Направление подготовки 38 .04 .08 Финансы и кредит

Направленность (профиль) программы «*Финансовая аналитика*»

Уровень высшего образования *Магистратура*

Год начала подготовки 2021 г.

Краснодар – 2021 г.

1. Цель и задачи дисциплины:

Цель изучения дисциплины «Финансовая эконометрика» является: формирование у будущих специалистов научного представления о методах, моделях и приемах, позволяющих сопоставлять количественные выражения закономерностям экономической теории на базе экономической статистики с использованием математико-статистического инструментария.

Задачи освоения дисциплины

- рассмотреть методы оценки, прогноза и имитации экономических и социально-экономических показателей, характеризующих состояние и развитие экономических систем финансовой сферы;

- охарактеризовать навыки практического применения современных инструментальных методов, технологий сбора, обработки, критической оценки финансовой информации, продвинутых методов экономического и финансового анализа, в том числе с использованием интеллектуально-аналитических систем в процессе проведения прикладных и (или) фундаментальных исследований при решении профессиональных задач в сфере финансов;

- объяснить навыки использования моделей прогнозирования и финансового моделирования, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, для разработки бизнес-планов, оценки стоимости объектов, формирования проектных решений в сфере финансового консалтинга.

Содержание дисциплины:

№ п/п	Наименование разделов / тем дисциплины
1.	<i>Раздел 1. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ</i>
2.	Тема 1. Классическая линейная модель множественной регрессии
3.	Тема 2. Различные типы моделей регрессии
4.	Тема 3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии
5.	<i>Раздел 2. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ</i>
6.	Тема 4. Временные ряды
7.	<i>Раздел 3 ОДНОМЕРНЫЕ УРАВНЕНИЯ И ИХ СИСТЕМЫ</i>
8.	Тема 5. Системы линейных эконометрических уравнений
Трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е. / 108 часов	

Форма контроля –зачет

Разработчик:

Доцент кафедры бухгалтерского учета и анализа
Краснодарского филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова

И.Н. Булатникова