

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Петровская Анна Викторовна  
Должность: Директор  
Дата подписания: 13.09.2024 13:25:07  
Уникальный программный ключ:  
798bda6555fbdebe827768f6f1710bd17a9070c31fdc1b6a6ac5a1108c9179

Приложение 3

к основной профессиональной образовательной программе  
по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит  
направленность (профиль) программы 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 финансов и кредита

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.03 Статистические методы в финансах**

**Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит**

**Направленность (профиль) программы Финансовая аналитика**

**Уровень высшего образования Магистратура**

**Год начала подготовки 2023**

Краснодар – 2022 г.

Составитель:  
к.э.н., доцент КФК О.П. Пидяшова

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры финансов и кредита  
Краснодарского филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова протокол № 6 от 10.02.2022 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

<b>I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ .....</b>	<b>4</b>
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
<b>II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>7</b>
<b>III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>14</b>
РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА.....	14
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ.....	15
ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ .....	15
ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ.....	15
ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ .....	15
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ .....	16
МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	16
<b>IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>17</b>
<b>V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ .....</b>	<b>17</b>
<b>VI. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ.....</b>	<b>18</b>
<b>АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>30</b>

# I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

## Цель и задачи освоения дисциплины

Целью учебной дисциплины «Статистические методы в финансах» является получение знаний в области статистических методов сбора, обработки анализа данных об образовании и функционировании финансовых ресурсов для успешного использования их в практической деятельности.

Задачами дисциплины являются:

1. Изучение статистической методологии.
2. Формирование умения обрабатывать статистические данные.
3. Приобретение навыков эффективной работы с исходными данными (выбор оптимальных статистических методов обработки и анализа данных);
4. Приобретение навыков интерпретировать результаты применения того или иного метода, адекватному использованию полученных оценок для формулировки аналитических выводов и решений.

## Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Статистические методы в финансах», относится к вариативной 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 с оценкой	Зачет с оценкой	Зачет с оценкой
<b>Контактная работа обучающихся с преподавателем (Контакт. часы), всего:</b>	<b>20</b>	<b>16</b>	<b>10</b>
1. Контактная работа на проведение занятий лекционного и семинарского типов, всего часов, в том числе:	<b>18</b>	<b>14</b>	<b>8</b>
• лекции	6	4	2
• практические занятия	12	10	6
• лабораторные занятия	-	-	-
в том числе практическая подготовка	-	-	-
2. Индивидуальные консультации (ИК)	-	-	-
3. Контактная работа по промежуточной аттестации (Кат)	2	2	2
4. Консультация перед экзаменом (КЭ)	-	-	-

5. Контактная работа по промежуточной аттестации в период экз. сессии / сессии заочников (Каттэк)	-	-	-
<b>Самостоятельная работа (СР), всего:</b>	<b>88</b>	<b>92</b>	<b>98</b>
в том числе:			
• самостоятельная работа в период экз. сессии (СРэк)	-	-	2
• самостоятельная работа в семестре (СРС)	88	92	96
в том числе, самостоятельная работа на курсовую работу	-	-	-
и другие виды	88	92	96

## 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)
<b>ПК-1.</b> Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	<b>ПК-1.1</b> Предоставление потребителю финансовых услуг, информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение сути финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг	<b>ПК-1.1. 3-1.</b> Знает основы эффективных межличностных коммуникаций, этику делового общения
		<b>ПК-1.1. 3-2.</b> Знает необходимый спектр финансовых продуктов и услуг
		<b>ПК-1.1. 3-3.</b> Знает экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности
		<b>ПК-1.1. У-1.</b> Умеет предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на его потребности и интересы
		<b>ПК-1.1. У-2.</b> Умеет учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента
	<b>ПК-1.1. У-3.</b> Умеет осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков, проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и с юридической точек зрения	
	<b>ПК-1.4</b> Определение (на основании запроса клиента) критериев отбора поставщиков	<b>ПК-1.4. 3-1.</b> Знает основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы, страхового сектора, рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования

	финансовых услуг и подбор поставщиков в соответствии с выделенными критериями	<b>ПК-1.4. У-1. Умеет</b> отстаивать интересы клиента в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг, собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг
<b>ПК-2.</b> Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля	<b>ПК-2.2</b> Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах, проведение стресс-тестов и сценарного анализа, составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском	<b>ПК-2.2. З-1. Знает</b> понятие безрискового актива, способы управления финансовыми рисками, принципы соотношения риска и доходности
		<b>ПК-2.2. З-2. Знает</b> методы количественного и качественного анализа финансовых показателей
		<b>ПК-2.2. У-1. Умеет</b> получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, использовать расчетные таблицы и калькуляторы
		<b>ПК-2.2. У-2. Умеет</b> выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля

## II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций для обучающихся очной формы обучения

Таблица 3

№ 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 (по темам)/ разделу или по всему курсу в целом)
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа/ КЭ, Каттэж, Катт	Всего					
<b>Семестр 2</b>												
1.	<p><b>Тема 1. Предмет и методология статистики в финансах</b>                      Финансы как объект статистического изучения. Значение статистического изучения финансов в современных условиях. Особенности методологии статистики в финансах. Место статистики финансов в единой системе учета и статистики. Организация статистики в финансово-кредитной сфере. Понятие о системе статистических показателей в финансах.</p>	1	2	-	-	4/-	7	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Т.	Р.
2.	<p><b>Тема 2. Статистика денежного обращения и кредита</b>                      Сущность процесса денежного обращения. Показатели денежного обращения, инфляции и цен. Денежная база. Информационная база статистического исследования денежной массы и её обращения. Система показателей статистики денежного обращения. Макроэкономические показатели: номинальная денежная масса, денежный оборот, скорость обращения денег, реальная денежная масса и др. Система денежных агрегатов. Статистические методы анализа и прогноза денежной массы и денежного обращения. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе. Простые и сложные проценты.</p>	2	4	-	-	28/-	34	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.

3.	<p><b>Тема 3. Банковская и биржевая статистика</b>  Предмет и задачи банковской статистики. Информационное обеспечение банковской статистики. Система показателей банковской статистики. Кредитные операции банков как объект изучения банковской статистики. Понятие кредита, кредитных отношений и кредитной системы. Показатели кредитных ресурсов и их использование. Показатели статистики краткосрочного кредитования. Показатели статистики долгосрочного кредитования. Методы статистического анализа показателей кредитных ресурсов и их использование. Статистический анализ банковской деятельности. Применение коэффициентов для анализа надежности банковской деятельности.</p> <p>Предмет и задачи биржевой статистики. Информационная база биржевой статистики. Система показателей фондовых бирж. Ценовые показатели биржевой статистики. Показатели объема биржевых торгов. Фондовые индексы и средние. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики. Показатели финансовых рынков.</p>	2	4	-	-	30/-	36	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Р.
4.	<p><b>Тема 4. Статистика страхования</b>  Предмет и задачи статистики страхования. Понятие страхования, страховой деятельности, страхового тарифа, страховой премии, страховых резервов. Виды страховых резервов. Информационное обеспечение статистического изучения страхового дела. Важнейшие классификации и группировки, используемые в статистике страхования. Статистические показатели деятельности страховых компаний: абсолютные, относительны и средние. Порядок расчета тарифных ставок по отдельным видам страхования: в личном страховании жизни, в имущественном страховании. Рейтинги страховых компаний.</p>	1	2	-	-	26/-	29	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.
	Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)	-	-	-	-	-/2	2	-	-	-	-	-
	Самостоятельная работа в период экз. сессии (СРЭК)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	<b>Итого</b>	<b>6</b>	<b>12</b>	-	-	<b>88/2</b>	<b>108</b>	x	x	x	x	x



## Этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций для обучающихся очно-заочной формы обучения

Таблица 3.1

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины	Трудоёмкость, академические часы						Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения (знания, умения)	Учебные задания для аудиторных занятий	Текущий контроль	Задания для творческого рейтинга (по теме(-ам)/ разделу или по всему курсу в целом)
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа/ КЭ, Каттэк, Катт	Всего					
<b>Семестр 3</b>												
1.	<p><b>Тема 1. Предмет и методология статистики в финансах</b>                      Финансы как объект статистического изучения. Значение статистического изучения финансов в современных условиях. Особенности методологии статистики в финансах. Место статистики финансов в единой системе учета и статистики. Организация статистики в финансово-кредитной сфере. Понятие о системе статистических показателей в финансах.</p>	1	2	-	-	4/-	7	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Т.	Р.
2.	<p><b>Тема 2. Статистика денежного обращения и кредита</b>                      Сущность процесса денежного обращения. Показатели денежного обращения, инфляции и цен. Денежная база. Информационная база статистического исследования денежной массы и её обращения. Система показателей статистики денежного обращения. Макроэкономические показатели: номинальная денежная масса, денежный оборот, скорость обращения денег, реальная денежная масса и др. Система денежных агрегатов. Статистические методы анализа и прогноза денежной массы и денежного обращения. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе. Простые и сложные проценты.</p>	1	4	-	-	29/-	34	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.

3.	<b>Тема 3. Банковская и биржевая статистика</b> Предмет и задачи банковской статистики. Информационное обеспечение банковской статистики. Система показателей банковской статистики. Кредитные операции банков как объект изучения банковской статистики. Понятие кредита, кредитных отношений и кредитной системы. Показатели кредитных ресурсов и их использование. Показатели статистики краткосрочного кредитования. Показатели статистики долгосрочного кредитования. Методы статистического анализа показателей кредитных ресурсов и их использование. Статистический анализ банковской деятельности. Применение коэффициентов для анализа надежности банковской деятельности. Предмет и задачи биржевой статистики. Информационная база биржевой статистики. Система показателей фондовых бирж. Ценовые показатели биржевой статистики. Показатели объема биржевых торгов. Фондовые индексы и средние. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики. Показатели финансовых рынков.	1	2	-	-	33/-	36	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Р.
4.	<b>Тема 4. Статистика страхования</b> Предмет и задачи статистики страхования. Понятие страхования, страховой деятельности, страхового тарифа, страховой премии, страховых резервов. Виды страховых резервов. Информационное обеспечение статистического изучения страхового дела. Важнейшие классификации и группировки, используемые в статистике страхования. Статистические показатели деятельности страховых компаний: абсолютные, относительны и средние. Порядок расчета тарифных ставок по отдельным видам страхования: в личном страховании жизни, в имущественном страховании. Рейтинги страховых компаний.	1	2	-	-	26/-	29	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.
	Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)	-	-	-	-	-/2	2	-	-	-	-	-
	Самостоятельная работа в период экз. сессии (СРэк)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	<b>Итого</b>	<b>4</b>	<b>10</b>	-	-	<b>92/2</b>	<b>108</b>					

## Этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций для обучающихся заочной формы обучения

Таблица 3.2

№ 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 (по теме(-ам)/ разделу или по всему курсу в целом)
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа/ КЭ, Катгэк, Катг	Всего					
<b>Семестр 3</b>												
1.	<p><b>Тема 1. Предмет и методология статистики в финансах</b>                      Финансы как объект статистического изучения. Значение статистического изучения финансов в современных условиях. Особенности методологии статистики в финансах. Место статистики финансов в единой системе учета и статистики. Организация статистики в финансово-кредитной сфере. Понятие о системе статистических показателей в финансах.</p>	-	1	-	-	6/-	7	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Т.	Р.
2.	<p><b>Тема 2. Статистика денежного обращения и кредита</b>                      Сущность процесса денежного обращения. Показатели денежного обращения, инфляции и цен. Денежная база. Информационная база статистического исследования денежной массы и её обращения. Система показателей статистики денежного обращения. Макроэкономические показатели: номинальная денежная масса, денежный оборот, скорость обращения денег, реальная денежная масса и др. Система денежных агрегатов. Статистические методы анализа и прогноза денежной массы и денежного обращения. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе. Простые и сложные проценты.</p>	0,5	2	-	-	31,5/-	34	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.

3.	<b>Тема 3. Банковская и биржевая статистика</b> Предмет и задачи банковской статистики. Информационное обеспечение банковской статистики. Система показателей банковской статистики. Кредитные операции банков как объект изучения банковской статистики. Понятие кредита, кредитных отношений и кредитной системы. Показатели кредитных ресурсов и их использование. Показатели статистики краткосрочного кредитования. Показатели статистики долгосрочного кредитования. Методы статистического анализа показателей кредитных ресурсов и их использование. Статистический анализ банковской деятельности. Применение коэффициентов для анализа надежности банковской деятельности. Предмет и задачи биржевой статистики. Информационная база биржевой статистики. Система показателей фондовых бирж. Ценовые показатели биржевой статистики. Показатели объема биржевых торгов. Фондовые индексы и средние. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики. Показатели финансовых рынков.	1	2	-	-	31/-	36	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Р.
4.	<b>Тема 4. Статистика страхования</b> Предмет и задачи статистики страхования. Понятие страхования, страховой деятельности, страхового тарифа, страховой премии, страховых резервов. Виды страховых резервов. Информационное обеспечение статистического изучения страхового дела. Важнейшие классификации и группировки, используемые в статистике страхования. Статистические показатели деятельности страховых компаний: абсолютные, относительны и средние. Порядок расчета тарифных ставок по отдельным видам страхования: в личном страховании жизни, в имущественном страховании. Рейтинги страховых компаний.	0,5	1	-	-	27,5/-	29	ПК-1.1 ПК-1.4 ПК-2.2	ПК-1.1 3-1, 3-2, 3-3, ПК-1.1. У-1, У-2, У-3 ПК-1.4 3-1 ПК-1.4. У-1 ПК-2.2 3-1, 3-2, ПК-2.2. У-1, У-2	О.	Р.А.З., Т.	Инд.п.
	Контактная работа по промежуточной аттестации (Катт)	-	-	-	-	-/2	2	-	-	-	-	-
	Самостоятельная работа в период экз. сессии (СРэк)	-	-	-	-	-/2	-	-	-	-	-	-
	<b>Итого</b>	<b>2</b>	<b>6</b>	-	-	<b>96/4</b>	<b>108/4</b>					

**Формы учебных заданий на аудиторных занятиях:**

*Опрос (О.)*

**Формы текущего контроля:**

*Тест (Т.)*

*Расчетно-аналитические задания (Р.а.з.)*

**Формы заданий для творческого рейтинга:**

*Индивидуальный проект (Инд.п.)*

*Реферат (Р.)*

### III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

#### РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

##### Основная литература:

1. Макроэкономическая статистика. Практикум: учебно-практическое пособие / Салин В.Н., под ред. и др. — Москва: КноРус, 2019. — 185 с. — Режим доступа: [https://reader.new.book.ru/?t=eyJhbGciOiJIUzUxMiIsInR5cCI6IkpXVCJ9.eyJ1c2VyX2lkIjotMSwiZ3JvdXBfaWQiOi0xLCJib29rX2lkIjo5MzExNDksImJvbmV2YWNjZXNzIjotMSwidXNlc19lbWVpbCI6Ii0iLCJ1c2VyX3R5cGUiOi0xLCJleHAiOjE2ODQzNTc5NTMsImVhdCI6MTY4NDMzNjMyM30.rSEyGDRh5BILzzCc3d\\_3Ajspm7nLz\\_LGSQZrgXjaLKwa\\_-0iy6hFPPy38si93WOhFXt-ukZ6wJ2k4L1mM\\_iTPg](https://reader.new.book.ru/?t=eyJhbGciOiJIUzUxMiIsInR5cCI6IkpXVCJ9.eyJ1c2VyX2lkIjotMSwiZ3JvdXBfaWQiOi0xLCJib29rX2lkIjo5MzExNDksImJvbmV2YWNjZXNzIjotMSwidXNlc19lbWVpbCI6Ii0iLCJ1c2VyX3R5cGUiOi0xLCJleHAiOjE2ODQzNTc5NTMsImVhdCI6MTY4NDMzNjMyM30.rSEyGDRh5BILzzCc3d_3Ajspm7nLz_LGSQZrgXjaLKwa_-0iy6hFPPy38si93WOhFXt-ukZ6wJ2k4L1mM_iTPg)
2. Клячкин, В.Н. Статистические методы анализа данных/ В.Н. Клячкин, Кувайскова Ю.Е., Алексеева В.А. – М.: Финансы и кредит, 2021. – 241 с. – Режим доступа: <https://znanium.com/read?id=382025>
3. Экономическая статистика: учебник / под ред. Ю.Н. Иванова. — 5-е изд., перераб. и доп. -М.: ИНФРА-М, 2021. — 548 с. — Режим доступа: <https://znanium.com/read?id=378042>

##### Дополнительная литература:

1. Саблина, Е. А. Статистика финансов: учебное пособие / Е.А. Саблина. — Москва: ИНФРА-М, 2021. — 288 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс]. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/3554. - ISBN 978-5-16-009092-4. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/read?id=398515>
2. Козлов, А. Ю. Статистический анализ данных в MS Excel : учебное пособие / А.Ю. Козлов, В.С. Мхитарян, В.Ф. Шишов. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 320 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/2842. - ISBN 978-5-16-004579-5. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/read?id=423653>
3. Иванов, Ю. Н. Экономическая статистика : учебник / под ред. Ю.Н. Иванова. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 584 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс]. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/7728. - ISBN 978-5-16-010399-0. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/read?id=416185>
4. Сплетухов, Ю. А. Страхование: учебное пособие / Ю.А. Сплетухов, Е.Ф. Дюжиков. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: ИНФРА-М, 2023. — 357 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-003575-8. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/read?id=415049>
5. Мелкумов, Я. С. Социально-экономическая статистика : учебное пособие / Я.С. Мелкумов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 186 с. —

(Высшее образование: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-005424-7. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/read?id=422181>

### **Нормативно-правовые документы:**

В рамках изучения дисциплины «Статистические методы в финансах» не используются.

## **ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ**

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

## **ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ**

1. ЭБС «ИНФРА–М» <http://znanium.com>
2. ЭБС «Лань» [www.e.lanbook.com](http://www.e.lanbook.com)
3. ЭБС ВООК.ru <http://www.book.ru>
4. ЭБС «Лань» Книжная коллекция «Инженерно-технические науки» [www.e.lanbook.com](http://www.e.lanbook.com)
5. **Лекториум** - просветительский проект: массовые открытые онлайн-курсы, открытый видеоархив лекций вузов России <https://www.lektorium.tv/>

## **ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ**

1. Крупнейший российский информационный портал в области науки, технологии, медицины и образования [elibrary.ru](http://elibrary.ru) <http://elibrary.ru>
2. Scopus – крупнейшая единая база данных, содержащая аннотации и информацию о цитируемости рецензируемой научной литературы, со встроенными инструментами отслеживания, анализа и визуализации данных
3. Статистическая база данных по российской экономике <http://www.gks.ru>

## **ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ», НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

1. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики РФ (статистические данные) <http://www.gks.ru/>
2. Официальный сайт Управления Федеральной службы государственной статистики по Краснодарскому краю и Республике Адыгея (статистические данные) <http://krsdstat.gks.ru/>
3. Российский статистический ежегодник [http://www.gks.ru/bgd/regl/b18\\_13/Main.htm](http://www.gks.ru/bgd/regl/b18_13/Main.htm)
4. Энциклопедиум [энциклопедии, словари, справочники] - справочный портал <http://enc.biblioclub.ru>

5. Clarivate Analytics - русскоязычный информационно-аналитический портал имеет раздел "Онлайн-семинары", которые проводятся на русском языке, бесплатно по базовым и расширенным возможностям информационных ресурсов, в т.ч. наукометрической базы данных "Web of Science" <http://info.clarivate.com/rcis>

6. On-line: газеты и журналы - коллекция гиперссылок на электронные версии СМИ открытого доступа: российские официальные, нормативные, центральные, региональные, местные, отраслевые, научные, образовательные, научно-популярные, литературно-художественные, молодёжные, зарубежные периодические издания на русском и на иностранных языках, размещённая на сайте филиала <http://www.sgpi.ru/?n=934>

7. КиберЛенинка - научная электронная библиотека (журналы) <http://cyberleninka.ru/>

8. Единое окно доступа к образовательным ресурсам - федеральная информационная система открытого доступа к интегральному каталогу образовательных интернет-ресурсов и к электронной библиотеке учебно-методических материалов для всех уровней образования: дошкольное, общее, среднее профессиональное, высшее, дополнительное <http://window.edu.ru/>

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

<b>№ п/п</b>	<b>Перечень информационных технологий, программного обеспечения</b>
1.	Операционная система Windows 10
2.	Microsoft Office Professional Plus: 2019 (MS Word, MS Excel, MS Power Point, MS Access)
3.	Антивирус Dr.Web Desktop Security Suite Комплексная защита
4.	Браузер Google Chrome
5.	Браузер Mozilla Firefox
6.	7-zip
7.	Adobe Reader

## **МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

Дисциплина «*Статистические методы в финансах*» 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:



для самостоятельной работы:

- 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 указания для обучающихся по освоению дисциплины «Рынок ценных бумаг (продвинутый уровень)» представлены в нормативно-методических документах:

Положение об интерактивных формах обучения (<http://www.rea.ru>)

Положение об организации самостоятельной работы студентов (<http://www.rea.ru>)

Положение о курсовых работах (<http://www.rea.ru>)

Положение о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов (<http://www.rea.ru>)

Положение об учебно-исследовательской работе студентов (<http://www.rea.ru>)

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

Оценивание результатов обучения по дисциплине для обучающихся 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>

5. Описание производственных ситуаций (кейсы)	различных ситуаций	Решение ситуационных задач на практическом занятии	Четырехбалльная
6. Вопросы к контрольной работе		Выполнение контрольной работы	Двухбалльная

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

Шкала оценки	Оценка	Критерий выставления оценки
100-процентная	отлично	85-100 % правильных ответов
	хорошо	65-84 % правильных ответов
	удовлетворительно	40-64 % правильных ответов
	неудовлетворительно	менее 40 % правильных ответов
двухбалльная	зачтено	выполнено
	незачтено	не выполнено
четырехбалльная	отлично	Обучающийся глубоко и прочно усвоил весь программный материал, исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно его излагает, тесно увязывает теорию с практикой. Обучающийся 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 самостоятельно обобщать и излагать материал, не допуская ошибок
	хорошо	Обучающийся 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
	удовлетворительно	Обучающийся 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
	неудовлетворительно	Обучающийся не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, с большими затруднениями выполняет практические работы.

**Зачет (с оценкой)** по результатам изучения дисциплины «Статистические методы в финансах» проводится в письменной форме. Зачетное задание включает два теоретических вопроса и практическое задание (расчетно-аналитическое).

## VI. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Оценочные материалы по дисциплине «Статистические методы в финансах» разработаны в соответствии с Положением об оценочных материалах в

федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова».

### ***Тематика курсовых работ/проектов***

Курсовая работа/проект по дисциплине «Статистические методы в финансах» учебным планом не предусмотрена

### ***Перечень вопросов зачету с оценкой:***

1. Предмет и задачи статистики денежного обращения и кредита.
2. Информационное обеспечение статистики денежного обращения.
3. Информационное обозначение статистики кредита.
4. Система показателей статистики денежного обращения.
5. Система показателей статистики кредита.
6. Категории денежного обращения: денежные агрегаты, денежная масса.
7. Система показателей денежного обращения.
8. Категории и система показателей денежного обращения: денежный мультипликатор, количество денег в обращении, скорость обращения.
9. Категории и система показателей кредита: понятие кредита, кредитных вложений.
10. Показатели оборачиваемости кредита: понятие, формулы расчета, исследование динамики.
11. Средняя длительность пользования кредитом, исследование динамики (индексы переменного, постоянного состава и структурных сдвигов).
12. Среднее число оборотов ссуд, динамика и оценка влияния отдельных факторов.
13. Предмет и задачи биржевой статистики.
14. Информационное обеспечение биржевой статистики.
15. Система показателей статистики фондовых бирж.
16. Фондовые индексы и средние.
17. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики.
18. Предмет и задачи статистики страхования.
19. Основные категории статистики страхования.
20. Классификации и группировки в статистике страхования.
21. Статистические показатели оценки деятельности страховых компаний.
22. Статистические показатели имущественного страхования.
23. Статистика социального государственного страхования.
24. Расчет нетто и брутто-ставок в имущественном страховании.
25. Расчет нетто и брутто ставок по дожитию.
26. Структура тарифных ставок при смешанном страховании жизни.
27. Статистические показатели устойчивости страхового дела.
28. Показатели статистического денежного обращения.
29. Статистическое изучение кассовых оборотов.
30. Понятие и виды ценных бумаг, задачи статистики.
31. Показатели статистики ценных бумаг.
32. Обобщающие показатели ценных бумаг.

33. Простые проценты и их применение в финансово-экономических расчетах.
34. Функции сложного процента.
35. Определение аккумулярованной суммы капитала.
36. Фактор фонда возмещения капитала.
37. Определение размера платежей для покрытия долга.
38. Показатели цен биржевых сделок.
39. Показатели объема биржевых торгов.
40. Статистические методы анализа показателей оборачиваемости кредита.

**Типовые задания к зачету с оценкой**

**Задача 1.**

Имеются данные по РФ за год, млрд. руб.:

Показатели	1 квартал	2 квартал	3 квартал	4 квартал
ВВП:				
в текущих ценах	558	615	712	822
в ценах предыдущего периода	508	506	605	646
Денежная масса - всего	265	294	327	352
в том числе наличные деньги	97	103	115	124

Определить:

- 1) индексы дефляторы ВВП по кварталам и в целом за год;
- 2) оборачиваемость денежной массы и наличности (количество оборотов) по кварталам и в целом за год;
- 3) скорость оборота денежной массы и наличности (в днях) по кварталам и в целом за год;
- 4) удельный вес наличных денег в общем объеме денежной массы;
- 5) абсолютный прирост скорости обращения денежной массы в целом и за счет изменения скорости обращения наличности и удельного веса наличных денег в общем объеме денежной массы.

Сделать выводы.

**Задача 2.**

Имеются следующие данные по двум отраслям экономики:

Отрасль экономики	Средний остаток кредита, млн. руб.		Число оборотов кредита	
	базисный период	отчетный период	базисный период	отчетный период
А	260	270	10	11
Б	140	180	12	13
В	320	345	11	13

Определить:

- 1) оборот по погашению за каждый период по каждой отрасли экономики и в целом;
- 2) индексы оборота по погашению, числа оборотов кредита и средних остатков кредита по каждой отрасли и в целом;
- 3) показать взаимосвязь исчисленных индексов;
- 4) абсолютное изменение оборота по погашению в целом по всем отраслям экономики, в том числе под влиянием отдельных факторов.

Сделать выводы.

**Задача 3.**

Имеются следующие данные, млрд. руб.:

Показатели	1 квартал	2 квартал	3 квартал	4 квартал
ВВП	558	615	711	822
Денежная масса – всего	242	266	282	323
в том числе наличные деньги	94,3	105,2	103,7	115,4

Определить:

- 1) показатели оборачиваемости денежной массы за каждый квартал;

- 2) цепные темпы роста, прироста ВВП и денежной массы;
- 3) скорость оборота наличных денег по кварталам;
- 4) доля наличности в общем объеме денежной массы;
- 5) изменение скорости обращения денежной массы за счет изменения скорости оборота наличных денег и доли наличности в общем объеме денежной массы.

Сделать выводы.

#### **Задача 4.**

Имеются следующие данные по отраслям экономики:

Отрасль экономики	Длительность пользования кредитом, дн.		Однодневный оборот по погашению, млн. руб.	
	базисный год	отчетный год	базисный год	отчетный год
А	65	52	11,5	10,8
Б	85	78	5,3	7,4
В	80	75	8,8	8,1

Определить:

- 1) средний остаток кредита по каждой отрасли экономики и в целом;
- 2) индексы среднего остатка кредита, длительности пользования кредитом и однодневного оборота по погашению по каждой отрасли и в целом по всем отраслям;
- 3) показать взаимосвязь исчисленных индексов;
- 4) структуру однодневного оборота по погашению;
- 5) абсолютное изменение среднего остатка кредита в целом по всем отраслям экономики, в том числе за счет изменений средней длительности пользования кредитом и однодневного оборота по погашению.

Сделать выводы.

#### **Задача 5.**

Имеются следующие показатели денежного обращения за 3 года, млрд. руб.:

Показатели	1 год	2 год	3 год
Наличные деньги в обращении (вне банков)	130,4	187,8	266,6
Остатки средств в национальной валюте на расчетных, текущих счетах и депозитах	254,1	260,5	438,1
ВВП (в текущих рыночных ценах)	2696	4545	5996

Определить:

- 1) общую сумму денежной массы за каждый период;
- 2) удельный вес наличности в общем объеме денежной массы;
- 3) скорость обращения наличных денег за каждый период;
- 4) скорость и время обращения денежной массы за каждый период;
- 5) абсолютное и относительное изменение ВВП по годам.

Сделать выводы.

### ***Типовые тестовые задания:***

*1. Предметом статистических методов в финансах является:*

- а) качественное противопоставление массовых финансовых явлений и процессов;
- б) количественное соотношение массовых финансовых явлений и процессов в неразрывной связи с их качественными характеристиками;
- в) количественное противоречие массовых явлений и процессов в неразрывной связи с их результативными характеристиками.

*2. При изучении количественной стороны статистика использует законы:*

- а) математики;
- б) философии;
- в) логики.

*3. Управления статистики финансов разрабатывают и анализируют:*

- а) межотраслевую статистическую отчетность;
- б) внутриотраслевую статистическую отчетность;
- в) бухгалтерскую отчетность и статистические формуляры.

4. Статистика финансов выполняет такие функции:

- а) оперативная, управленческая, контрольная;
- б) оперативная, фиксирующая, аналитическая;
- в) оперативная, контрольная, аналитическая.

5. Статистика характеризует формирование и использование денежных доходов и фондов в процессе финансово-хозяйственной деятельности с помощью:

- а) оперативной функции;
- б) аналитической функции;
- в) контрольной функции.

### **Типовые расчетно-аналитические задания:**

**Задача 1.** Имеются данные по РФ за год, млрд. руб.:

Показатели	1 квартал	2 квартал	3 квартал	4 квартал
ВВП:				
в текущих ценах	580	640	745	855
в ценах предыдущего периода	530	528	635	665
Денежная масса	276,8	305,3	337,5	368,7
всего	103	109	119	130
в т. ч. наличные деньги				

Определить:

- 1) скорость оборота денежной массы и наличности (количество оборотов) по кварталам и в целом за год;
- 2) время оборота денежной массы и наличности (в днях) по кварталам и в целом за год;
- 3) удельный вес наличных денег в общем объеме денежной массы;
- 4) абсолютный прирост скорости обращения денежной массы в целом и в том числе за счет изменения скорости обращения наличности и удельного веса наличных денег в общем объеме денежной массы;
- 5) индексы дефляторы ВВП по кварталам и в целом за год.

Сделать выводы.

**Задача 2.** Имеются следующие данные по двум отраслям экономики:

Отрасль промышленности	Средний остаток кредита, млн. руб.		Число оборотов кредита	
	базисный год	отчетный год	базисный год	отчетный год

А	340	365	9	10
Б	185	210	11	13
В	415	440	8	11

Определить:

- 1) оборот по погашению по каждой отрасли промышленности и в целом за каждый год;
- 2) индексы оборота по погашению и средних остатков кредита по каждой отрасли и в целом;
- 3) индексы числа оборотов по каждой отрасли и в среднем по всем отраслям;
- 4) показать взаимосвязь исчисленных индексов;
- 5) абсолютное изменение оборота по погашению в целом по всем отраслям промышленности, в том числе под влиянием отдельных факторов.

Сделать выводы.

### **Задача 3.**

По имеющимся данным определить: рентабельность страховой организации, рентабельность страховой деятельности (руб.).

Поступившие страховые платежи 600 000 руб.

Затраты на проведение страхования 5 000 руб.

Комиссионное вознаграждение за перестрахование 200 000 руб.

Выплата страховых возмещений 360 000 руб.

Отчисления в специальные резервные фонды 180 000 руб.

Собственный капитал страховой компании 2 250 000 руб.

### ***Примеры вопросов для опроса:***

- 1) сущность и значение статистических методов в финансах;
- 2) методология статистики при исследовании финансов;
- 3) основные категории и понятия статистики в финансах;
- 4) формы выражения статистических показателей;
- 5) функции статистики при изучении финансов;
- 6) современная организация статистики при изучении финансов;
- 7) финансовый сектор экономики и его составляющие;
- 8) источники информации о кредитно-денежной политике;
- 9) источники информации о государственном бюджете и внебюджетных фондах;
- 10) источники информации о платежном балансе страны.

### ***Тематика индивидуальных проектов:***

## **Тема 2. Статистика денежного обращения и кредита**

По официальным данным Банка России выберите экономический показатель в динамике (период времени не менее 12 месяцев. При необходимости динамический ряд преобразуйте методом укрупнения интервалов.

Исследуйте интенсивность ряда динамики. Для этого рассчитайте аналитические показатели: абсолютные прироста (ценные и базисные), темпы роста (ценные и базисные), темпы прироста (ценные и базисные), абсолютное содержание одного процента прироста, средний уровень ряда динамики, средний абсолютный прирост, средний годовой темп роста и прироста. Показатели ряда динамики представьте в табличной форме.

Определите основную тенденцию динамического ряда методом аналитического выравнивания. Проведите анализ параметров модели тренда. Изобразите графически исходные и теоретические значения уровней ряда. Рассчитайте колеблемость уровней ряда тренда. Для расчётов используйте блок «Анализ данных» ППП «Excel». Сделайте выводы.

#### **Тема 4. Статистика страхования**

Проведите группировку 50 страховых компаний РФ по выбранному признаку (выбрать самостоятельно) и рассчитайте характеристики вариационного ряда: среднюю арифметическую, моду, медиану, условные и центральные моменты распределения, показатели вариации, коэффициенты асимметрии и эксцесса. Проанализируйте исчисленные показатели и сделайте заключение о форме распределения исследуемого признака.

#### ***Тематика рефератов:***

##### **Тема 1. Предмет и методология статистики в финансах**

1. Финансы как объект статистического изучения.
2. Особенности методологии статистики в финансах.
3. Место статистики финансов в единой системе учета и статистики.
4. Организация статистики в финансово-кредитной сфере.
5. Система статистических показателей в финансах

##### **Тема 3. Банковская и биржевая статистика**

1. Система показателей банковской статистики.
2. Кредитные операции банков как объект изучения банковской статистики.
3. Статистический анализ банковской деятельности.
4. Система показателей фондовых бирж. Фондовые индексы и средние.
5. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики.



## Типовая структура зачетного задания

### *Наименование оценочного материала*

**Вопрос 1.** Средняя длительность пользования кредитом, исследование динамики (индексы переменного, постоянного состава и структурных сдвигов).

**Вопрос 2.** Статистические показатели имущественного страхования.

**Задача 1.** Имеются данные по РФ за год, млрд. руб.:

Показатели	1 квартал	2 квартал	3 квартал	4 квартал
ВВП:				
в текущих ценах	580	640	745	855
в ценах предыдущего периода	530	528	635	665
Денежная масса - всего	276,8	305,3	337,5	368,7
в т. ч. наличные деньги	103	109	119	130

Определить:

- 1) скорость оборота денежной массы и наличности (количество оборотов) по кварталам и в целом за год;
- 2) время оборота денежной массы и наличности (в днях) по кварталам и в целом за год;

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

Таблица 5

Шкала оценивания	Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
«отлично» / зачтено	<p><b>ПК-1.</b> Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг</p> <p><b>ПК-2.</b> Разработка финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля</p>	<p><b>ПК-1.1</b> Предоставление потребителю финансовых услуг, информации о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам, разъяснение сути финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг</p> <p><b>ПК-1.4</b> Определение (на основании запроса клиента) критериев отбора поставщиков финансовых услуг и подбор поставщиков в соответствии с выделенными критериями</p> <p><b>ПК-2.2</b> Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах, проведение стресс-тестов и сценарного анализа, составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском</p>	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- основы эффективных межличностных коммуникаций, этику делового общения</li> <li>- необходимый спектр финансовых продуктов и услуг</li> <li>- экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности</li> <li>- основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы, страхового сектора, рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования</li> <li>- понятие безрискового актива, способы управления финансовыми рисками, принципы соотношения риска и доходности</li> <li>- методы количественного и качественного анализа финансовых показателей</li> </ul> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на его потребности и интересы,</li> <li>- учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента,</li> <li>- осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков, проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и с юридической точек зрения</li> <li>- отстаивать интересы клиента в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг, собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг</li> <li>- получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, использовать расчетные таблицы и калькуляторы</li> <li>- выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля</li> </ul>	Продвинутый

Шкала оценивания	Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
«хорошо» / зачтено			<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- основы эффективных межличностных коммуникаций, этику делового общения</li> <li>- необходимый спектр финансовых продуктов и услуг</li> <li>- экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности</li> <li>- основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы, страхового сектора, рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования</li> <li>- понятие безрискового актива, способы управления финансовыми рисками, принципы соотношения риска и доходности</li> <li>- методы количественного и качественного анализа финансовых показателей</li> </ul> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на его потребности и интересы,</li> <li>- учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента,</li> <li>- осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков, проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и с юридической точек зрения</li> <li>- отстаивать интересы клиента в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг, собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг</li> <li>- получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, использовать расчетные таблицы и калькуляторы</li> <li>- выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля</li> </ul>	<b>Повышенный</b>
«удовлетворительно» / зачтено			<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- основы эффективных межличностных коммуникаций, этику делового общения</li> <li>- необходимый спектр финансовых продуктов и услуг</li> <li>- экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности</li> </ul>	<b>Базовый</b>

Шкала оценивания	Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
			<p>- основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы, страхового сектора, рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования</p> <p>- понятие безрискового актива, способы управления финансовыми рисками, принципы соотношения риска и доходности</p> <p>- методы количественного и качественного анализа финансовых показателей</p> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b></p> <p>- предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на его потребности и интересы,</p> <p>- учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента,</p> <p>- осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков, проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и с юридической точек зрения</p> <p>- отстаивать интересы клиента в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг, собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг</p> <p>- получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, использовать расчетные таблицы и калькуляторы</p> <p>- выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля</p>	
«неудовлетворительно» / не зачтено			<p><b>Не знает на базовом уровне:</b></p> <p>- основы эффективных межличностных коммуникаций, этику делового общения</p> <p>- необходимый спектр финансовых продуктов и услуг</p> <p>- экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности</p> <p>- основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы, страхового сектора, рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования</p> <p>- понятие безрискового актива, способы управления финансовыми рисками, принципы соотношения риска и доходности</p>	Компетенции не сформированы

Шкала оценивания	Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
			<p>- методы количественного и качественного анализа финансовых показателей</p> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b></p> <p>- предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на его потребности и интересы,</p> <p>- учитывать текущую финансовую ситуацию и перспективу при оценке предложений, направленных на решение финансовых задач клиента,</p> <p>- осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг, профессиональные консультации, гарантирующие понимание всех преимуществ, возможностей и рисков, проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и с юридической точек зрения</p> <p>- отстаивать интересы клиента в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг, собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг</p> <p>- получать, интерпретировать и документировать результаты исследований, использовать расчетные таблицы и калькуляторы</p> <p>- выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля</p>	

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

**Факультет экономики, менеджмента и торговли**

**Кафедра финансов и кредита**

**АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.03 Статистические методы в финансах**

<b>Направление подготовки</b>	<b>38.04.08 Финансы и кредит</b>
<b>Направленность (профиль) программы</b>	<b>Финансовая аналитика</b>
<b>Уровень высшего образования</b>	<b>Магистратура</b>

**Краснодар– 2022 г.**

## 1. Цель и задачи дисциплины:

**Целью** дисциплины «Статистические методы в финансах» является получение знаний в области статистических методов сбора, обработки анализа данных об образовании и функционировании финансовых ресурсов для успешного использования их в практической деятельности.

**Задачами** дисциплины являются:

1. Изучение статистической методологии.
2. Формирование умения обрабатывать статистические данные.
3. Приобретение навыков эффективной работы с исходными данными (выбор оптимальных статистических методов обработки и анализа данных);
4. Приобретение навыков интерпретировать результаты применения того или иного метода, адекватному использованию полученных оценок для формулировки аналитических выводов и решений.

## 2. Содержание дисциплины:

№ п/п	Наименование разделов / тем дисциплины
1.	Предмет и методология статистики в финансах.
2.	Статистика денежного обращения и кредита.
3.	Банковская и биржевая статистика.
4.	Статистика страхования.
<b>Трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е. / 108 часов</b>	

**Форма контроля – зачет с оценкой**

**Составитель:**

к.э.н., доц., доц. О.П. Пидяшова