

**Аннотация
рабочей программы учебной дисциплины
«Финансовая эконометрика»**

1. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цель изучения учебной дисциплины

Целью изучения учебной дисциплины «Финансовая эконометрика» является формирование у обучающихся комплексного и научного представления о методах выявления и количественного описания взаимосвязей между различными экономическими и финансовыми показателями, а также закономерностей их изменения во времени, приобретение практических навыков применения аппарата математической статистики в сочетании с современными информационными технологиями для обработки массивов эмпирических данных при построении моделей финансово-экономических процессов.

1.2 Задачи учебной дисциплины:

расширение и углубление теоретических знаний о качественных особенностях экономических и финансовых систем, количественных взаимосвязях и закономерностях их развития;

овладение методологией и методикой построения и применения эконометрических моделей как для анализа текущего финансового состояния, так и для оценки закономерностей развития и прогнозирования будущих финансовых показателей;

изучение наиболее типичных финансово-экономических моделей и получение навыков практической работы с ними.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВПО

2.1. Цикл (раздел) ООП:

Дисциплина «Финансовая эконометрика» относится к вариативной части профессионального цикла подготовки магистров по направлению 38.04.08 «Банки и банковская деятельность».

2.2. Взаимосвязь учебной дисциплины с другими учебными дисциплинами ООП

Дисциплина опирается на знания, умения и компетенции обучающихся, полученные при изучении следующих учебных дисциплин: «Основы экономической теории»; «Высшая математика»; «Статистика»; «Финансовый анализ», а также владение основами современных компьютерных технологий.

Знания полученные при освоении дисциплины «Финансовая эконометрика» служат базой для изучения методов прогнозирования финансово-экономических показателей, моделирования экономических процессов, а приобретенные навыки могут быть использованы при прохождении научно-педагогической, научно-исследовательской и преддипломной практик, а также для написания магистерской диссертации.

3. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ СОДЕРЖАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения учебной дисциплины:

Код соответствующей компетенции по ГОС	Наименование компетенций	Результат освоения (знать, уметь, владеть)
ОПК-3	Готовность самостоятельно принимать профессиональные решения в соответствии с законодательными и нормативными актами, на	Знать: методологические основы эконометрики. Уметь: применять на практике математико-статистические методы моделирования и количественного

	основе теории и практики финансово-кредитных отношений	анализа реальных экономических и финансовых явлений и содержательно интерпретировать их результаты. Владеть: навыками принятия профессиональных решений в соответствии с законодательными и нормативными актами
ПК-3	Способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	Знать: эконометрический метод исследования. Уметь: строить эконометрические модели; Владеть: методологией эконометрического исследования.
ПК-12	Способность определять оптимальные направления инвестиционной деятельности предприятия, диверсифицировать ее, прогнозировать экономические последствия принимаемых инвестиционных решений; разрабатывать и реализовывать инвестиционную стратегию предприятия	Знать: методы количественного анализа реальных экономических и финансовых явлений. Уметь: использовать эконометрические пакеты прикладных программ Владеть: навыками анализа реальных экономических и финансовых явлений
ПК-15	Способность руководить финансовыми службами и подразделениями предприятий, учреждений, организаций, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и органов местного самоуправления, временными творческими коллективами, создаваемыми для разработки новых проектных решений в сфере финансов	Знать: методы исследования взаимосвязи между социально-экономическими и финансовыми факторами. Уметь: использовать навыки исследования взаимосвязей между социально-экономическими и финансовыми факторами. Владеть: методологическими основам исследования взаимосвязи между социально-экономическими и финансовыми факторами.

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Раздел 1. Модели и методы регрессионного анализа

Тема 1.1. Эконометрика и ее место в ряду математико-статистических и финансовых дисциплин

Тема 1.2. Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях

Тема 1.3. Множественная регрессия и корреляция

Тема 1.4. Методы оценки параметров нелинейных эконометрических моделей

Тема 1.5. Системы эконометрических уравнений

Раздел 2. Моделирование в финансовой эконометрике

Тема 2.1. Моделирование временных рядов

Тема 2.2. Модели финансовой эконометрики

Тема 2.3. Информационные технологии эконометрических исследований

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

При преподавании дисциплины могут использоваться традиционные и интерактивные образовательные технологии, в том числе:

чтение лекций в форме монолога с использованием мультимедийного комплекса, а также с элементами диалога и дискуссии;

семинарская система обучения (устный опрос, тестирование, решение практических заданий, анализ конкретных финансово-экономических ситуаций, разработка проблемы и подготовка индивидуальных работ, презентаций);

научно-исследовательская работа (подготовка научных статей по проблематике, связанной с тематической направленностью дисциплины, участие в научно-практических конференциях);

консультации преподавателей в рамках внеаудиторной работы.

Разработчик рабочей программы:

Шарый К.В., к.э.н., старший преподаватель кафедры финансов