

**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:

- 1) расширение и углубление теоретических знаний о качественных особенностях экономических и финансовых систем, количественных взаимосвязях и закономерностях их развития;
- 2) 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;
- 3) 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 относится к вариативной части обязательных дисциплин профессионального цикла (Б1.В.ОД.2).

2.2. Взаимосвязь учебной дисциплины с другими учебными дисциплинами ООП

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

Освоение дисциплины «Финансовая эконометрика» необходимо как предшествующий этап для изучения следующих дисциплин: «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Финансовый менеджмент (продвинутый уровень)»; для преддипломной практики; при подготовке 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)
ПК-4	способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений	Знать: методологические основы эконометрики. Уметь: применять на практике математико-статистические методы моделирования и количественного анализа реальных экономических и финансовых явлений и содержательно

		интерпретировать их результаты. Владеть: навыками принятия профессиональных решений в соответствии с законодательными и нормативными актами
ПК-24	способность осуществлять разработку теоретических и новых эконометрических моделей процессов, методов и инструментов проведения исследований в сфере профессиональной деятельности	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 используются следующие технологии:

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

– семинарская система обучения (устный опрос, компьютерное тестирование, выполнение творческих (проблемных) заданий, анализ конкретных ситуаций, разработка проблемы и подготовка рефератов, презентаций);

– научно-исследовательская работа (подготовка научных статей по проблематике, связанной с тематической направленностью дисциплины).

– консультации преподавателя в рамках внеаудиторной работы.

Разработчик рабочей программы:

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