

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ФИНАНСОВАЯ ЭКОНОМЕТРИКА

Блок и шифр дисциплины: Б1.Б.7

1. Цель освоения дисциплины «Финансовая эконометрика»

Цель курса – освоение методов корреляционного, регрессионного, факторного анализа, применяемых для построения и оценки различных эконометрических моделей в финансовой сфере.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП магистратуры

Дисциплина «Финансовая эконометрика» относится к дисциплинам базовой части Блока 1. Слушатели магистратуры, изучающие данную дисциплину, должны уметь строить эконометрические модели и оценивать их параметры, а также проверять гипотезы о свойствах финансово-экономических показателей и формах их связи, проверять выполнение предпосылок, лежащих в основе моделей, знание последствий нарушения тех или иных предпосылок, умение избавляться от последствий такого рода нарушений.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

общекультурные компетенции:

способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу (ОК-1);

готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения (ОК-2).

профессиональные компетенции в сфере научно-исследовательской деятельности:

способность осуществлять разработку теоретических и новых эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты (ПК-20);

способность выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками (ПК-23).

В результате освоения дисциплины «Финансовая эконометрика» обучающийся должен:

Знать:

- методы корреляционного, регрессионного, факторного анализа, применяемых для построения и оценки различных эконометрических моделей на основе использования финансовых данных.

Уметь использовать знание эконометрики в профессиональной деятельности:

- строить эконометрические модели и оценивать их параметры, а также проверять гипотезы о свойствах экономических показателей и формах их связи;
- проверять выполнение предпосылок, лежащих в основе моделей, знание последствий нарушения тех или иных предпосылок, умение избавляться от последствий такого рода нарушений;
- получение навыков использования результатов экономического анализа для прогноза и принятия обоснованных экономических решений;
- получение практических навыков реализации изученных эконометрических техник в самом распространенном программном продукте, позволяющем осуществлять статистический анализ данных - Microsoft Excel.

Владеть техникой проверки адекватности эконометрической модели реальным данным.

4. Структура учебной дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 часов.

5. Основные разделы дисциплины

Предмет и задачи финансовой эконометрики. Парная линейная регрессионная модель. Метод наименьших квадратов. Основные статистические распределения. Проверка гипотез. Статистические свойства оценок, полученных методом наименьших квадратов. Оценка качества регрессии. Множественная регрессия. Ошибки спецификации. Процедуры отбора объясняющих переменных. Обобщенный метод наименьших квадратов. Автокорреляция. Анализ временных рядов. Прогнозирование.

Составитель рабочей программы: д.ф-м.н., профессор С.Л. Садов., КНЦ УрО РАН, к.э.н., доц. Швецова И.Н.