АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.О.01 «Финансовая эконометрика»

Наименование образовательной программы: Финансовая экономика
Код и наименование направления подготовки: 38.04.08 Финансы и кредит
Форма обучения: очная, заочная
Планируемые результаты освоения дисциплины/модуля/практики:

1.1 Дисциплина Б1.О.01 Финансовая эконометрика обеспечивает овладение следующими компетенциями:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
УК ОС-1	Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий.	УК ОС-1.1	Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода
ОПК ОС-2	Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в сфере финансов и экономики, а также использовать современные информационно-аналитические системы.	ОПК ОС-2.1	Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в сфере финансов и экономики
ПКо ОС — А	Способность применять макроэкономические модели для анализа проблем, возникающих в экономической практике; вербально, графически, математически и эмпирически анализировать и прогнозировать как поведение экономических агентов, так и влияние государственной политики на макроэкономические процессы	ПКо ОС — А.1	Способен применять макроэкономические модели для анализа проблем, возникающих в экономической практике

1.2 В результате освоения компетенции у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ/трудовые или профессиональные действия	Код компонента компетенции	Результаты обучения

	УК ОС-1.1	на уровне знаний: – методы критического анализ проблемных ситуаций; на уровне умений: – на основе системного подхода осуществляет критический анализ проблемных ситуаций
	ОПК ОС- 2.1	на уровне знаний : знает современные инструментальные методы экономического анализа для решения исследовательских и практических задач; на уровне умений : использует современные инструментальные методы экономического анализа для решения исследовательских и практических задач
Использовать формулы для расчета стоимостей в соответствии со стандартами, правилами и методологией определения стоимостей организаций (код С/03.7) (частично)[1] / Периодическая актуализация основных положений и принципов методологии финансового планирования (С/01.7) (частично) [2]	ПКо ОС — А.1	на уровне знаний : – представление об процессах макроэкономики для анализа экономических проблем; на уровне умений : – использует современные модели макроэкономики для анализа экономических проблем.

Объем дисциплины/модуля/практики: общая трудоемкость дисциплины 5 з.е. по учебному плану, что составляет 180 ак. ч. / 135 астр.час., из них:

- для очной формы обучения: на контактную работу выделено 64 акад. часов / 48 астр.час. (из них: 32 акад. часов / 24 астр. час. лекционных занятий, 32 акад. часов / 24 астр. час. практических занятий), 80 акад. часов / 60 астр. час – на самостоятельную работу обучающихся, 36 акад. часов / 27 астр. час – на контроль (самостоятельная работа обучающихся в период зачетно-экзаменационной сессии).

- для заочной формы обучения: на контактную работу выделено 12 акад. часов / 9 астр.час. (из них: 6 акад. часов / 4,5 астр. час. лекционных занятий, 6 акад. часов / 4,5 астр. час. практических занятий), 159 акад. часов / 119,25 астр. час – на самостоятельную работу

[1] Профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками» Утвержден приказом Министерства приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 30 августа 2018 № 564н (Зарегистрировано в Минюсте России 17.09.2018 N 52177).

[2] Профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию» Утвержден приказом Министерства приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от от 19 марта 2015 № 167н (Зарегистрировано в Минюсте России 09.04.2015 N 36805).

обучающихся, 9 акад. часов / 6,75 астр. час – на контроль (самостоятельная работа обучающихся в период зачетно-экзаменационной сессии).

Структура дисциплины/модуля/этапы практики:
Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации**
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Тема 1	Регрессионный анализ и эндогенность	10 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	6	О, ОПЗ
Тема 2	Оценка систем уравнений (анализ в программной среде EViews или Gretl).	16 (4*)	4 (2*)	-	4 (2*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 3	Модели панельных данных.	16 (4*)	4 (2*)	-	4 (2*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 4	Нелинейные модели и отбор (анализ в программной среде EViews или Gretl).	14 (8*)	4 (4*)	-	4 (4*)	-	6	О, ОПЗ
Тема 5	Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA (анализ в программной среде EViews или Gretl).	10 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	6	О, ОПЗ
Тема 6	Причинность и блочная экзогенность. (анализ в программной среде EViews или Gretl).	12 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 7	Методология векторных авторегрессий (VAR) / (анализ в программной среде EViews или Gretl)..	12 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 8	Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR (анализ в программной среде EViews или Gretl).	10 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	6	О, ОПЗ
Тема 9	Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью	16 (8*)	4 (4*)	-	4 (4*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 10	Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни (анализ в программной среде EViews или Gretl).	16 (8*)	4 (4*)	-	4 (4*)	-	8	О, ОПЗ
Тема 11	Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов (анализ в программной среде EViews или Gretl).	12 (4*)	2 (2*)	-	2 (2*)	-	8	О, Т
Промежуточная аттестация		**36**	**-**	**-**	**-**	**36**	**-**	Экзамен

Всего:	180	32	-	32	36	80	Экзамен

Используемые сокращения:
Л - занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР - лабораторные работы (вид занятий семинарского типа;
ПЗ - практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР - индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ -занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.
СРО - самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.
** формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), письменный отчет по практическому занятию (ОПЗ), тестирование (Т)*
*** форма промежуточной аттестации: экзамен*

Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации**
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Тема 1	Регрессионный анализ и эндогенность	12	-	-	-	-	12	О, ОПЗ
Тема 2	Оценка систем уравнений (анализ в программной среде EViews или Gretl).	14	-	-	-	-	14	О, ОПЗ
Тема 3	Модели панельных данных.	18	2	-	-	-	16	О, ОПЗ
Тема 4	Нелинейные модели и отбор (анализ в программной среде EViews или Gretl).	16	-	-	2	-	14	О, ОПЗ
Тема 5	Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA (анализ в программной среде EViews или Gretl).	14	-	-	-	-	14	О, ОПЗ
Тема 6	Причинность и блочная экзогенность. (анализ в программной среде EViews или Gretl).	15	-	-	-	-	15	О, ОПЗ
Тема 7	Методология векторных авторегрессий (VAR) / (анализ в программной среде EViews или Gretl)..	18 (2*)	2 (2*)	-	2	-	14	О, ОПЗ
Тема 8	Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR (анализ в программной среде EViews или Gretl).	14	-	-	-	-	14	О, ОПЗ
Тема 9	Нелинейные модели временных рядов. Модели	16	2	-		-	14	О, ОПЗ

	временных рядов с условной гетероскедастичностью							
Тема 10	Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни (анализ в программной среде EViews или Gretl).	18 (2*)	-	--	2 (2*)	-	16	О, ОПЗ
Тема 11	Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов (анализ в программной среде EViews или Gretl).	16	-	-	-	-	16	О, Т
Промежуточная аттестация		**9**	**-**	**-**	**-**	**9**	**--**	Экзамен
Всего:		**180**	**6**	**-**	**6**	**9**	**159**	Экзамен

Используемые сокращения:
Л - занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР - лабораторные работы (вид занятий семинарского типа;
ПЗ - практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР - индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ -занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.
СРО - самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.
** формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), письменный отчет по практическому занятию (ОПЗ), тестирование (Т)*
*** форма промежуточной аттестации: экзамен*

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Основная литература:

1. Кэмерон Э.К., Триведи П.К., Микроэконометрика: методы и их применения; кн. 1,2, М.: Дело, 2015

2. Носко, В. П. Эконометрика: учебник: гриф ДО. Кн. 2, ч. 3, 4: Системы одновременных уравнений, панельные данные, модели с дискретными и ограниченными объясняемыми переменными [Ч. 3]. Временные ряды: дополнительные главы. Модель стохастической границы [Ч. 4] / В. П. Носко. - М.: Дело, 2011. - (Академический учебник). - Библиогр.: с. 311-312, 563-566.

3. Грин, У. Эконометрический анализ, кн.1.2, М. : Дело, 2016.