

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра *финансов и экономического анализа*

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ

УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

«АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ФИНАНСОВО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ РЯДОВ»

Уровень подготовки

МАГИСТРАТУРА

(высшее образование - бакалавриат; высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит"

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

заочная

Уфа 2015

Исполнители:

доцент

должность



подпись

Орлова Е.В.

расшифровка подписи

Заведующий кафедрой ФиЭА

Финансов и экономического анализа

наименование кафедры

личная подпись



расшифровка подписи

Кощегулова И.Р.

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования

**«УФИМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АВИАЦИОННЫЙ
ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

Кафедра *финансов и экономического анализа*

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ

УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

«АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ФИНАНСОВО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ РЯДОВ»

Уровень подготовки

МАГИСТРАТУРА

(высшее образование - бакалавриат; высшее образование – специалитет, магистратура)

Направление подготовки (специальность)

38.04.08. "Финансы и кредит"

(код и наименование направления подготовки, специальности)

Направленность подготовки (профиль, специализация)

"Финансы и кредит"

(наименование профиля подготовки, специализации)

Квалификация (степень) выпускника

Магистр

Форма обучения

заочная

Уфа 2015

Исполнители:

доцент

должность

Орлова Е.В.

подпись

расшифровка подписи

Заведующий кафедрой ФиЭА

Финансов и экономического анализа

наименование кафедры

личная подпись

Коцегулова И.Р.

расшифровка подписи

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина *Анализ и прогнозирование финансово-экономических рядов* является дисциплиной *вариативной* части (*обязательные* дисциплины, код Б1 В 5).

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 380408 Финансы и кредит, утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от "30" марта 2015 г. № 325.

Целями освоения дисциплины являются: формирование устойчивых знаний в области методов исследования финансово-экономических временных рядов; умения оценивать тенденции развития социально-экономических систем и прогнозировать их динамику с использованием экономико-математического инструментария; развитие логического мышления и умений самостоятельно изучать научную литературу по анализу временных рядов и их приложениям

Задачи:

- расширение и углубление теоретических знаний о качественных особенностях финансово-экономических процессов, количественных взаимосвязях и закономерностях развития экономики;
- овладение методиками построения эконометрических моделей временных рядов;
- изучение современных эконометрических методов прогнозирования динамики финансово-экономических процессов;
- формирование практических навыков работы с компьютерными программами эконометрического моделирования и прогнозирования, способностей интерпретировать полученные результаты.

Дисциплина *Анализ и прогнозирование финансово-экономических рядов* читается в первом семестре и обеспечивается формированием компетенций на пороговом уровне в области статистической обработки экономических данных, моделирования экономических процессов на предыдущих уровнях высшего образования (бакалавриат, специалитет).

Исходящие компетенции:

№	Компетенция	Код	Уровень освоения, определяемый этапом формирования компетенции	Название дисциплины (модуля), для которой данная компетенция является входной
1	Способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления	ПК-1	Базовый	Анализ и оценка эффективности проектных решений Моделирование финансово-банковской деятельности ГИА, НИР
2	Способностью обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК-11	Базовый	Риск-менеджмент в системе управления хозяйствующих субъектов ГИА, НИР

2. Перечень результатов обучения

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций.

Планируемые результаты обучения по дисциплине

№	Формируемые компетенции	Код	Знать	Уметь	Владеть
1	Способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления	ПК-1	<ul style="list-style-type: none"> – современные методы и модели эконометрического анализа финансово-экономической информации; – методы построения моделей многофакторных линейных и нелинейных регрессий; – методы и модели анализа финансово-экономических временных рядов 	<ul style="list-style-type: none"> – применять информационные технологии моделирования для решения финансовых задач 	<ul style="list-style-type: none"> - методикой построения эконометрических моделей анализа финансовой информации; - компьютерным инструментарием финансового моделирования
2	Способностью обосновать на основе анализа финансово-экономических рисков стратегию поведения экономических агентов на различных сегментах финансового рынка	ПК-11	<ul style="list-style-type: none"> – методы формирования прогнозных оценок финансовых показателей; – методы оценки адекватности и точности прогноза 	<ul style="list-style-type: none"> – осуществлять прогноз развития исследуемого процесса (объекта) на основе эконометрического подхода; – с использованием компьютерного инструментария проводить оценку эффективности альтернативных управленческих решений по минимизации последствий рисков событий 	<ul style="list-style-type: none"> - методикой прогнозирования финансовой информации; - подходами формирования обоснованных управленческих решений на основе эконометрической методологии

3. Содержание и структура дисциплины (модуля)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы (108 часов).

Трудоемкость дисциплины по видам работ

Вид работы	Трудоемкость, час.
	1 семестр
Лекции (Л)	6
Практические занятия (ПЗ)	-
Лабораторные работы (ЛР)	8
КСР	3
Курсовая проект работа (КР)	-
Расчетно - графическая работа (РГР)	-
Самостоятельная работа (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий, подготовка к лабораторным и практическим занятиям, коллоквиумам, рубежному контролю и т.д.)	82
Подготовка и сдача экзамена	
Подготовка и сдача зачета	9
Вид итогового контроля (зачет, экзамен)	зачет

Содержание разделов и формы текущего контроля

№	Наименование и содержание раздела	Количество часов					Литература, рекомендуемая студентам*	Виды интерактивных образовательных технологий**	
		Аудиторная работа				СРС			Всего
		Л	ПЗ	ЛР	КСР				
1	<p>Введение. Экономическая динамика и ее эконометрический анализ. Объект, предмет и задачи эконометрического исследования динамики экономических систем. Специфика временных рядов в экономических системах. Виды временных рядов. Показатели состояния и динамики временного ряда. Исследование и выявление закономерностей в социально-экономических системах на основе временных рядов. Меры в финансовых данных. Законы распределения финансовых данных.</p>	4		4		10	18	6.1.1 п. 2.1, 2.2, 2.3 6.1.2. п. 1,3 6.2.2 п.4 6.2.3 п. 6 6.2.4 п. 2	лекция классическая, проблемная лекция, проблемное обучение, работа в команде
2	<p>Современные методы моделирования и прогнозирования социально-экономического развития. Основные элементы временного ряда. Корреляция и автокорреляция уровней финансовых временных рядов. Выявление структуры временного ряда. Проверка гипотезы о существовании тренда. Регрессионный анализ временных рядов, оценка параметров уравнения регрессии, модели экономического роста. Метод наименьших квадратов, предпосылки метода наименьших квадратов, теорема Гаусса-Маркова. Метод последовательных разностей. Аддитивная и мультипликативная модели временного ряда. Методы изучения и выявления тенденции, сезонных колебаний и случайной компоненты временного ряда. Интерполяция и экстраполяция. Прогнозирование временных рядов с разной структурой.</p>	6		4	1	14	25	6.1.1 п. 2.4 6.1.2 п. 6 6.1.3 п. 7 6.2.4 п.7 6.2.5 п. 3 6.2.6 п. 5	лекция-визуализация, работа в команде
3	<p>Анализ и моделирование стационарных и нестационарных временных рядов. Понятие стационарности временного ряда. Модели</p>	4		4	1	14	23	6.1.1 п. 2.4 6.1.2 п. 5	лекция-визуализация,

	стационарных и нестационарных временных рядов и их идентификация. Тестирование стационарности временного ряда. Примеры финансовых стационарных и нестационарных временных рядов.							6.2.1 п.4 6.1.3 п. 5	проблемное обучение, работа в команде
4	Динамические эконометрические модели. Модели с распределенным лагом. Модели авторегрессии. Краткосрочный и долгосрочный мультипликатор. Метод инструментальных переменных. Метод максимального правдоподобия. Примеры макроэкономической динамики. Стохастические временные ряды. Прогнозирование возможных рисков на основе эконометрической модели. Формирование управленческих решений по нейтрализации рисков	2		4	1	14	25	6.1.2. п.3 6.2.1 п. 3 6.2.3 п. 3 6.2.4 п.6	лекция-визуализация, проблемное обучение, деловая игра, работа в команде
5	Информационные технологии в эконометрических исследованиях временных рядов. Заключение. Современные информационные технологии моделирования финансовых временных рядов. Способы описания экономических систем в зависимости от типа исходных данных. Эконометрический компьютерный инструментарий.	2		4		11	17	6.1.1. п. 2.5 6. 2.1. п. 7	лекция-визуализация, обучение на основе опыта

Лабораторные работы

№ ЛР	№ раздела	Наименование лабораторных работ	Кол-во часов
1	1	Построение и экономический анализ показателей состояния и динамики временного ряда.	4
2	2	Эконометрический анализ регрессионных моделей временных рядов.	4
3	3	Построение моделей белого шума, авторегрессии, авторегрессии и скользящего среднего в финансовых	4
4	3	Финансовые рынки, моделирование ценовой динамики	4
5	5	Моделирование экономической динамики на основе моделей с распределенным лагом	4

Практические занятия (семинары)

Не предусмотрены учебным планом

Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

Основная литература

1. Орлова Е.В. Эконометрическое моделирование и прогнозирование. Учебное пособие. – Уфа: УГАТУ, 2013. – 250с.
2. Эконометрика / И. И. Елисеева [и др.]. – Москва: Юрайт, 2012. – 453 с.; ISBN 978-5-9916-1930-1. URL:http://www.library.ugatu.ac.ru/pdf/teach/Ekonometrika_Yeliseeva_mag_2012.pdf
3. Эконометрика [Электронный ресурс]: [учебник для студентов экономических специальностей вузов, аспирантов и преподавателей] / К. В. Балдин [и др.]; под ред. В. Б. Уткина. – 2-е изд. – Москва: Дашков и К,

Дополнительная литература

1. Орлова Е. В. Эконометрика: учебное пособие. – Уфа: Гилем, 2006. – 170 с.
2. Валентинов, В. А. Эконометрика [Электронный ресурс]: – 2-е изд. – Москва: Дашков и К, 2009. – 448 с. – Доступ по логину и паролю из сети Интернет. – ISBN 978-5-394-00165-9. – <URL:<http://e.lanbook.com/>>
3. Чураков Е. П. Прогнозирование экономических временных рядов: учебное пособие / Е. П. Чураков. – М.: Финансы и статистика, 2008. – 204 с.
4. Прасолов А. В. Математические методы экономической динамики: учебное пособие / А. В. Прасолов. – СПб: Лань, 2008. – 349 с.

Интернет-ресурсы (электронные учебно-методические издания, лицензионное программное обеспечение)

На сайте библиотеки <http://library.ugatu.ac.ru/> в разделе "Информационные ресурсы", подраздел "Доступ к БД" размещены ссылки на интернет-ресурсы.

Материально-техническое обеспечение дисциплины

Для проведения лекционных занятий требуется мультимедийный проектор и ноутбук. Лабораторные работы проходят в дисплейных классах 3-404, 410, 412, 414, 413, 103, 105 с доступом в интернет.

Адаптация рабочей программы для лиц с ОВЗ

Адаптированная программа разрабатывается при наличии заявления со стороны обучающегося (родителей, законных представителей) и медицинских показаний (рекомендациями психолого-медико-педагогической комиссии). Для инвалидов адаптированная образовательная программа разрабатывается в соответствии с индивидуальной программой реабилитации.