

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

Институт общественных наук
Школа публичной политики и управления
Кафедра международного менеджмента

УТВЕРЖДЕНА
кафедрой международного
менеджмента

Протокол от «1» апреля
2016 г.

№ 2

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.6.1 Прикладная эконометрика (Applied Econometrics for Finance)

(индекс, наименование дисциплины, в соответствии с учебным планом)

38.04.02 Менеджмент

(код, наименование направления подготовки (специальности))

«Международные финансы. Международная англоязычная магистратура»

(направленность (профиль))

Магистр

(квалификация)

Очная

(форма обучения)

Год набора – 2018 г.

Москва, 2017 г.

Автор–составитель:

доцент кафедры международного менеджмента, PhD Нейштадт И. В.

Декан факультета

международных программ
ИОН РАНХиГС

Перепелица М.А.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
 - 6.1. Основная литература
 - 6.2. Дополнительная литература
 - 6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы
 - 6.4. Нормативные правовые документы
 - 6.5. Интернет-ресурсы
 - 6.6. Иные источники
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.6.1 Прикладная эконометрика для финансистов (Applied Econometrics for Finance) обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-4	Способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения.	ПК-4.2	Способность производить расчеты на основании типовых методик и существующей нормативно-правовой базы; проводить количественное прогнозирование и моделирование управления бизнес-процессами; анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели; анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/ профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
Тактическое управление процессами организации производства. Анализ информации и подготовка информационно-аналитических материалов.	ПК-4.2	Обучающийся умеет производить расчеты на основании типовых методик и существующей нормативно-правовой базы; проводить количественное прогнозирование и моделирование управления бизнес-процессами; анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели; анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины

Объем дисциплины: 108/3 81/3

Контактная работа: 36/27

Лекции 8/6

Лабораторные работы

Практические занятия 28/21

Самостоятельная работа 36/27

Место дисциплины в структуре ОП ВО

индекс и наименование дисциплины: Б1.В.ДВ.6.1 Прикладная эконометрика для финансистов (Applied Econometrics for Finance)

курс(ы), семестр(ы) или триместр(ы) ее освоения в соответствии с учебным планом:
1 курс 2 семестр

дисциплина реализуется до изучения:

Б1.В.ОД.9 Управление рисками и инструменты хеджирования (Risk Management and Hedging Instruments)

дисциплина реализуется после изучения:

Б1.В.ОД.2 Корпоративные финансы (Corporate Finance)

форма(ы) промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом: Экзамен

3. Содержание и структура дисциплины

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/ЭО, ДОТ*	ЛР/ ЭО, ДОТ*	ПЗ/ ЭО, ДОТ*	КС Р		
Тема 1	Линейная регрессионная модель		2/1,5		2/1,5			Д
Тема 2	Линейная регрессионная модель		2/1,5		2/1,5			Д
Тема 3	Линейная регрессионная модель		2/1,5		2/1,5		2/1,5	Д
Тема 4	Диагностика регрессии		2/1,5		2/1,5		2/1,5	Д
Тема 5	Диагностика регрессии				2/1,5		2/1,5	Д
Тема 6	Диагностика регрессии				2/1,5		2/1,5	Д

Тема 7	Подготовка дипломированного финансового аналитика				2/1,5		2/1,5	Д
Тема 8	Дополнительные материалы по регрессионному анализу				4/3		2/1,5	Д
Тема 9	Дополнительные материалы по регрессионному анализу				4/3		2/1,5	Д
Тема 10	Дополнительные материалы по регрессионному анализу				4/3		2/1,5	Д
Промежуточная аттестация								Экзамен
Всего:		108/3 81/3	8/6		28/21		36/27	36/27

*Примечание – диспут (Д)

Содержание дисциплины

№	Наименование	Содержание
Тема 1	Линейная регрессионная модель	Диагностический тест. Корреляционный анализ. Введение в простые линейные регрессионные модели. Занятие по Eviews
Тема 2	Линейная регрессионная модель	Простая линейная регрессионная модель. Заключение по теме простых линейных регрессионных моделей. Занятие по Eviews
Тема 3	Линейная регрессионная модель	Многофакторная линейная регрессионная модель. Заключение по теме многофакторных линейных регрессионных моделей. Занятие по Eviews
Тема 4	Диагностика регрессии	Строгая мультиколлинеарность. Дамми-переменные. Ловушка при применении дамми-переменных. Нестрогая мультиколлинеарность. Занятие по Eviews
Тема 5	Диагностика регрессии	Гетероскедастичность. Автокорреляция 1. Занятие по Eviews
Тема 6	Диагностика регрессии	Автокорреляция 2. Стабильность структуры. Занятие по Eviews

№	Наименование	Содержание
Тема 7	Подготовка дипломированного финансового аналитика	Обзор количественных методов финансового анализа
Тема 8	Дополнительные материалы по регрессионному анализу	Ошибка спецификации. Нелинейные регрессионные функции. Занятие по Eviews
Тема 9	Дополнительные материалы по регрессионному анализу	Система одновременных уравнений. Проблема идентификации. Занятие по Eviews
Тема 10	Дополнительные материалы по регрессионному анализу	Анализ временных рядов данных. Занятие по Eviews

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости, обучающихся и промежуточной аттестации.

4.1.1. В ходе реализации дисциплины используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

При проведении занятий лекционного типа: диспут

при проведении занятий семинарского типа: диспут

4.1.2. Экзамен (зачет) проводится с применением следующих методов (средств): Экзамен в форме реферата

4. 2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Дискуссии в классе:

Discussions in class:

Подсчитайте и интерпретируйте пример коэффициента корреляции

Проведите различие между зависимыми и независимыми переменными в линейной регрессии

Интерпретируйте регрессионный коэффициент

Подсчитайте прогнозируемую величину для зависимой переменной, принимая во внимание модель оценки регрессии и величину независимой переменной

Объясните ориентированные расчеты, лежащие в основе линейной регрессии

Дайте определение и подсчитайте стандартную остаточную ошибку

Дайте определение, подсчитайте и интерпретируйте коэффициент детерминации

Подсчитайте доверительный интервал для коэффициента регрессии

Сформулируйте нулевую и альтернативную гипотезу о величине генеральной совокупности регрессионного коэффициента, выберите подходящую статистику критерия и определите, опровергается ли нулевая гипотеза при данном уровне значимости

Подсчитайте и интерпретируйте доверительный интервал для прогнозируемой величины зависимой переменной

Обсудите дисперсионный анализ (ANOVA) регрессионного анализа и интерпретируйте результаты первого

Сформулируйте уравнение множественной регрессии для описания отношений между зависимой переменной, нескольких независимых переменных, а затем определите статистическую значимость каждой независимой переменной и интерпретируйте полученные коэффициенты

Сформулируйте нулевую и альтернативную гипотезу о величине генеральной совокупности регрессионного коэффициента, выберите подходящую статистику критерия и определите, опровергается ли нулевая гипотеза при данном уровне значимости, используя односторонний и двусторонний критерий, а затем интерпретируйте результаты теста

Подсчитайте r -величины результата множественной регрессии

Дайте объяснение к расчетам по множественной регрессионной модели

Определите, интерпретируйте и выучите, как провести различие между коэффициентом детерминации R -квадрат и скорректированным коэффициентом детерминации во множественной линейной регрессионной модели.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации.

4.3.1. Формируемые компетенции

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-4	Способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения.	ПК-4.2	Способность производить расчеты на основании типовых методик и существующей нормативно-правовой базы; проводить количественное прогнозирование и моделирование управления бизнес-процессами; анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели; анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.

4.3.2 Типовые оценочные средства

Реферат:

Написание и защита курсовой работы по теме "Эмпирические методы исследования в финансах и экономике", которая будет оцениваться отдельно и максимально может принести 4 зачетных единицы. Инструкция по написанию научно-исследовательской работы будет выдана отдельно. Она будет расположена в папке с учебными материалами.

Шкала оценивания.

Показатель оценивания	Критерий оценивания
Обучающийся умеет производить расчеты на основании типовых методик и существующей нормативно-правовой базы; проводить количественное прогнозирование и моделирование управления бизнес-процессами; анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели; анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Не умеет 2. В целом успешно, но не систематически осуществляемые умения 3. В целом успешные, но содержащие отдельные пробелы умения 4. В целом успешные, но содержащие отдельные пробелы умения 5. Сформированное умение

Баллы (рейтинговой оценки), %	Оценка	Требования к знаниям
100-81	5, «отлично»	<ul style="list-style-type: none"> - Оценка «отлично» выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает его на экзамене, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение. - Учебные достижения в семестровый период и результатами рубежного контроля демонстрируют высокую степень овладения программным материалом.
80-61	4, «хорошо»	<ul style="list-style-type: none"> - Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения

		<p>при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.</p> <p>- Учебные достижения в семестровый период и результатами рубежного контроля демонстрируют хорошую степень овладения программным материалом.</p>
60-41	3, «удовлетворительно»	<p>- Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.</p> <p>- Учебные достижения в семестровый период и результатами рубежного контроля демонстрируют достаточную (удовлетворительную) степень овладения программным материалом.</p>
40-0	2, «неудовлетворительно»	<p>- Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.</p> <p>- Учебные достижения в семестровый период и результатами рубежного контроля демонстрировали не высокую степень овладения программным материалом по минимальной планке.</p>
45-100	Зачет	<p>- Курс полностью освоен. Студент показывает хороший стандартный уровень знаний всех аспектов, использует терминологию и словообразование и хорошо применяет теорию к решению задач.</p>
0 - 44	Незачет	<p>- Студент не подготовлен и не может показать достаточного знания материала курса.</p>

4.4. Методические материалы

Доклад должен соответствовать следующим требованиям:

Ясность: ответ должен быть четким. Идеи в ответе должны быть связными и понятными. Стил ь письма должен способствовать пониманию, не затруднять его. Пишите короткими, понятными предложениями, организованными в небольшие, связные абзацы.

Доводы: ответ должен быть в виде структурированного и связного аргумента на всей его протяжённости. Перечисления заимствованных идей и перифраз первоначального текста заданий недостаточно. В вашем ответе должен содержаться логичный довод.

Структура: ответ должен быть структурированным: в нем должно быть вступление, основная часть, заключение, а также возможные подпункты. Отдельные мысли должны

быть разделены абзацами, которые должны следовать единой логической и тематической "нити" от одного абзаца к другому.

Концептуальная ясность: доклад должен отражать четкое понимание используемых терминов. Термины должны использоваться во всех частях доклада. От студента ожидается особое внимание к основным положениям курса. Постарайтесь давать определения, когда впервые употребляете термин.

Актуальность и разборчивость: в докладе должны содержаться только материалы, относящиеся к теме доклада. Насколько бы не была интересна эта косвенная информация, это не принесет вам дополнительных баллов. Будьте готовы читать большое количество материалов и писать настолько кратко, насколько это возможно.

Презентация: доклад должен быть напечатан, отредактирован и тщательно вычитан. Работа должна быть надлежащим образом разделена на абзацы, иметь правильную грамматику, написание отдельных слов и оформленный список ссылок. За неудовлетворительную грамматику, неудачный выбор слов и опечатки будет снижаться оценка. Надлежаще оформленный список ссылок и полный перечень использованной литературы в конце работы обязательны. Доклад должен быть напечатан с 12 шрифтом и с двойным межстрочным интервалом. Если возможно, печатайте доклад с двух сторон листа в целях экономии бумаги.

Специальные знания: в работе над докладом следует использовать материалы и источники, соответствующие первому году обучения. Недостаток специальных знаний и недостаточная исследовательская работа являются наиболее распространенными препятствиями, которые мешают написать хороший доклад. Онлайн-источники не всегда однородны по своему качеству, поэтому не стоит основываться в своей работе только на них. Не полагайтесь только на интернет источники. Не стоит ограничиваться лишь несколькими книгами из списка вспомогательной литературы. Не стоит читать литературу в случайном порядке. Расходуйте время с умом, обращаясь к вспомогательной литературе, перечисленной в буклете и списке литературы других изданий уважаемых авторов. В целом, чем больше материалов вы прочитаете, тем лучше у вас получится доклад. Но вам необязательно цитировать и ссылаться на все эти книги в вашем докладе. Иначе вы рискуете превратить свой доклад в набор цитат. Чтение литературы по предмету позволит вам углубить знания и написать хороший доклад без непосредственного привлечения отрывков из этих книг.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Курс по прикладной эконометрике включает фрагменты учебной программы по подготовке дипломированных финансовых аналитиков. Форма и методика обучения включает лекции, практикумы по решению задач, интерактивные методы обучения в форме кейсов и анализ данных с использованием Eviews, а также подготовку дипломированных финансовых аналитиков с привлечением специалистов из Ernst & Young.

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для

самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

6.1. Основная литература.

1. Pawlowsky-Glahn, Vera, et al. Statistics in Practice : Modeling and Analysis of Compositional Data, John Wiley & Sons, Incorporated, 2015. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=1895896>.
2. Rohatgi, Vijay K., and A. K. Ehsanes Saleh. An Introduction to Probability and Statistics, John Wiley & Sons, Incorporated, 2015. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=4038785>.

6.2. Дополнительная литература.

1. Hanneman, Robert A., et al. Basic Statistics for Social Research, John Wiley & Sons, Incorporated, 2012. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=861634>.
2. World, Bank. International Debt Statistics 2016, World Bank Publications, 2015. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=4397389>.
3. Zacks, Shelemyahu. Examples and Problems in Mathematical Statistics, John Wiley & Sons, Incorporated, 2013. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=1589028>.

6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.

6.4. Нормативные правовые документы.

6.5. Интернет-ресурсы.

6.6. Иные источники.

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Для проведения лекционных и практических занятий необходимо следующее оборудование: доска, маркеры, компьютер и проектор. Программы: Microsoft Excel, Microsoft Word, IBM SPSS