

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Макроэкономическое и финансовое прогнозирование (Macroeconomic and Financial Forecasting)

наименование дисциплины

Автор: доцент кафедры международного менеджмента, PhD Нейштадт И. В.

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.02 Менеджмент

Квалификация (степень) выпускника: Магистр

Форма обучения: Очная

Цель освоения дисциплины:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-5	Владение методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде.	ПК-5.2	Способность использовать методы экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде; оценивать принимаемые решения с точки зрения их влияния на финансовые результаты и финансовое положение корпорации.

План курса:

№	Наименование	Содержание
Тема 1	Введение	Обзор регрессионного анализа. Оценка исследований, основанных на множественной регрессии. Как управлять проектами в эконометрике
Тема 2	Основы Макроэкономики I	Регрессионные модели с ограниченными зависимыми переменными.
Тема 3	Основы Макроэкономики II	Динамические эконометрические модели. Модели с распределенным запаздыванием.
Тема 4	Прогнозирование временных рядов I	Эконометрика временных рядов. Модели авторегрессионного интегрированного скользящего среднего (ARIMA)
Тема 5	Прогнозирование временных рядов II	Модели авторегрессионного интегрированного скользящего среднего (ARIMA) (продолжение). Модели с авторегрессионной условной
Тема 6	Прогнозирование временных рядов III	Промежуточный тест. Модели оценки рисков стоимости. Тесты причинности.
Тема 7	Эконометрика единичного корня	Нестационарные временные ряды. Тесты единичного корня

№	Наименование	Содержание
Тема 8	Моделирование I	Коинтеграция и модель коррекции ошибок
Тема 9	Моделирование II	Моделирование сезонных колебаний.
Тема 10	Измерение эффективности	Стохастический пограничный анализ (если позволит время). Занятие, посвященное повторению пройденного

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

Темы для дискуссии:

Discussion topics:

Дайте точное определение прогноза и проведите различие между прогнозом, моделью и бизнес-планом.

Назовите три критических фактора, которые следует оценивать в случае составления любого прогноза.

Опишите проблему идентификации, обеспечения соответствия мер защиты внешним условиям и чувствительности, окружающие роль догадки при прогнозировании.

Определите три основных метода прогнозирования, которые используют финансовые менеджеры.

Почему компании создают прогнозы?

Критическая роль предпосылок.

Типовые оценочные средства

Term Project:

Прогнозирование экономических и финансовых переменных с глобальной оценкой рисков стоимости

Макроэкономическое прогнозирование в условиях глобального финансового кризиса

Основная литература:

- 1.Samonas, Michael. Financial Forecasting, Analysis and Modelling : A Framework for Long-Term Forecasting, John Wiley & Sons, Incorporated, 2015. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=1895753>.