

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ****Финансовая эконометрика (Financial Econometrics)***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 на основе множественной регрессии. Как запустить проект в эконометрике
Тема 2	Основы эконометрики I	Модели регрессии с ограниченной зависимой переменной
Тема 3	Основы эконометрики II	Динамические эконометрические модели. Модели с распределенным лагом.
Тема 4	Прогнозирование временных рядов I	Временные ряды эконометрики. Модели ARIMA
Тема 5	Прогнозирование временных рядов II	Модели ARIMA (продолжение). ARCH and GARCH модели.
Тема 6	Прогнозирование временных рядов III	Промежуточный экзамен. Модели VAR. .

№	Наименование	Содержание
Тема 7	Единичный корень эконометрики	Нестационарные временные ряды, критерий единичных корней
Тема 8	Моделирование I	Коинтеграция и модель исправления ошибок
Тема 9	Моделирование II	Моделирование сезонности
Тема 10	Измерение эффективности	Стохастический граничный анализ. Ревизионная сессия

#### **Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

##### **Темы для дискуссии:**

##### **Discussion topics:**

Точно определите прогноз и найдите отличие прогноза от модели и бизнес-плана.

Определите три критических фактора для оценки в любой ситуации прогнозирования.

Опишите вопросы идентификации, согласованности и чувствительности, связанные с ролью предположения в прогнозировании.

Определите три основных метода прогнозирования, используемых финансовыми менеджерами.

Почему фирмы прогнозируют?

Критическая роль предположения.

#### **Типовые оценочные средства**

##### **Курсовой проект:**

Прогнозирование экономических и финансовых переменных с глобальными макроэкономическими прогнозами в глобальном финансовом кризисе

##### **Основная литература:**

1. Fabozzi, Frank J., et al. Basics of Financial Econometrics : Tools, Concepts, and Asset Management Applications, Wiley, 2014. ProQuest Ebook Central, <https://ebookcentral.proquest.com/lib/ranepa-ebooks/detail.action?docID=1645271>.