

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич
Должность: врио ректора
Дата подписания: 11.08.2025 14:51:13
Уникальный программный ключ:
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf35f08

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
ФГБОУ ВО «Тверской государственный университет»

Утверждаю:
Руководитель ООП
С.М. Дудаков
«25» августа 2021 г.



Рабочая программа дисциплины (модуля) (с аннотацией)

Эконометрика финансовых рынков

Направление подготовки

09.03.03. Прикладная информатика

Профиль подготовки

Прикладная информатика в экономике

Для студентов 4 курса

очной формы обучения

Составитель: к.ф.-м.н Сидорова О.И.

Тверь, 2021

I. Аннотация

Рабочая программа по курсу «Эконометрика финансовых рынков» разработана в соответствии с требованиями Федерального Государственного образовательного стандарта высшего образования и полностью соответствует учебному плану подготовки бакалавров по направлению 09.03.03. Прикладная информатика.

Основной целью данного курса является формирование у обучающихся навыков по практическому применению вероятностно-статистического подхода к анализу финансовых активов в условиях неопределенности, дать обучающимся представление о современных подходах к количественному анализу процессов, происходящих на финансовых рынках и ознакомить с эконометрическими моделями и методами, эффективно применяющимися при их анализе.

1. Цель и задачи дисциплины

Цели изучения данной дисциплины:

Ознакомить обучающихся с теоретических моделями и методами количественного анализа рынка ценных бумаг и кредитных инструментов в условиях неопределенности, развить навыки обработки эмпирического материала, включая построение модели, ее оценку проверку на адекватность.

Задачи изучения данной дисциплины:

В процессе изучения этого курса студенты должны сформировать представление о моделировании показателей финансовых рынков, научиться выявлять и количественно оценивать взаимосвязи между финансовыми показателями, подтверждать или опровергать адекватность существующих теоретических моделей, строить прогнозы.

2. Место дисциплины в структуре ООП

Курс «Эконометрика финансовых рынков» является элективной дисциплиной 3 из раздела «Дисциплины профиля подготовки» части, формируемой участниками образовательных отношений, из блока 1 учебного плана.

Для успешного усвоения курса обязательно требуются знания математического анализа, линейной алгебры, теории вероятностей и математической статистики, экономической теории. Знание основ эконометрики и теории случайных процессов желательно.

Знания и навыки, полученные в рамках данной дисциплины, полезны при осуществлении научно-исследовательской и проектно-технологической работы, а также при выполнении выпускной квалификационной работы.

3. Объем дисциплины: 5 зачетных единиц, 180 академических часов, в том числе:

контактная аудиторная работа: лекции 15 часов, практические занятия 45 часов, в т.ч. практическая подготовка - часов;

самостоятельная работа: 120 часов.

4. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы (формируемые компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-1 Способен применять системный подход и математические методы в формализации решения прикладных задач	ПК-1.1 Проводит анализ состояния разработок по теме исследуемой задачи ПК-1.2 Осуществляет формальную постановку исследуемой задачи ПК-1.3 Дает научное обоснование выбора метода и решает прикладную задачу ПК-1.4 Проводит аттестацию результатов научных исследований
ПК-3 Способен проводить обследование организаций, выявлять информационные потребности пользователей, формировать требования к информационной системе	ПК-3.1 Определяет возможности достижения соответствия типовой информационной системы первоначальным требованиям заказчика ПК-3.2 Дает формальное описание требований к информационным системам конкретного назначения в конкретной предметной области ПК-3.3 Выявляет первоначальные информационные потребности заказчика

5. Форма промежуточной аттестации и семестр прохождения – зачёт, 7 семестр.

6. Язык преподавания русский.