

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Емельянов Сергей Геннадьевич

Должность: ректор

Дата подписания: 06.02.2020 20:44:39

Уникальный программный ключ:

9ba7d3e34c012eba476f1d100c3f9e90d11000000000000000000000000000000

Аннотация к рабочей программе дисциплины «Анализ финансовых временных рядов»

Цель преподавания дисциплины – изучение магистрами основных понятий, моделей и методов анализа случайных процессов в экономике.

Задачи изучения дисциплины

- формирование у магистров основных понятий и положений анализа финансовых временных рядов;
- усвоение фундаментальных понятий и методов анализа финансовых временных рядов;
- приобретение магистрами знаний и практических навыков обработки финансовых временных рядов и инструментальных средств для решения задач в своей профессиональной деятельности.

Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины

ПК-1: способность 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-2: способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов;

ПК-24: способность проводить исследование проблем финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных, для разработки эффективных методов ее обеспечения с учетом фактора неопределенности.

Разделы дисциплины

- 1 Виды и построение временных рядов.
- 2 Составляющие элементы временного ряда.
- 3 Показатели временного ряда и методы их исчисления.
- 4 Основные типы тенденций и уравнений тренда.
- 5 Методы распознавания типа тренда и оценки его параметров.
- 6 Методы распознавания типа колебаний и оценки параметров колеблемости.
- 7 Вероятностная оценка существенности (надежности установления) параметров тренда и колеблемости.
- 8 Методы изучения и измерения устойчивости уровней ряда и тренда.
- 9 Изучение динамики комплекса взаимосвязанных признаков.
- 10 Моделирование и прогнозирование временных рядов (динамики).