

ФГБОУ ВО «БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, ФИНАНСОВ И БИЗНЕСА

Утверждено:  
на заседании кафедры  
протокол от «12» января 2022 г. № 5  
Зав. кафедрой

  
\_\_\_\_\_ Р.Х.Бахитова

Согласовано:  
Председатель УМК института

  
\_\_\_\_\_ /Л.Р. Абзалилова

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

**Продвинутые инструментальные методы экономического анализа**

Обязательная часть

**программа магистратуры**

Направление подготовки (специальность)  
38.04.08 Финансы и кредит

Направленность (профиль) подготовки  
Финансовая аналитика и принятие решений в условиях цифровизации

Квалификация  
магистр

Разработчик (составитель):  
доцент, к.ф.-м.н.

  
\_\_\_\_\_

Абзалилова Л.Р.

Для приема: 2022

Уфа 2022 г.

Составитель Абзалилова Л.Р.

Рабочая программа дисциплины утверждена на заседании кафедры цифровой экономики и коммуникации протокол от «12» января 2022 г. № 5

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу дисциплины, утверждены на заседании кафедры \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_,  
протокол № \_\_\_\_ от « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_ г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ / \_\_\_\_\_ Ф.И.О./

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу дисциплины, утверждены на заседании кафедры \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_,  
протокол № \_\_\_\_ от « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_ г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ / \_\_\_\_\_ Ф.И.О./

Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу дисциплины, утверждены на заседании кафедры \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_,  
протокол № \_\_\_\_ от « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_ г.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ / \_\_\_\_\_ Ф.И.О./

## Оглавление

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций.....	4
2. Цель и место дисциплины в структуре образовательной программы .....	4
3. Содержание рабочей программы (объем дисциплины, типы и виды учебных занятий, учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся) .....	4
4. Фонд оценочных средств по дисциплине .....	4
4.1. Перечень компетенций и индикаторов достижения компетенций с указанием соотнесенных с ними запланированных результатов обучения по дисциплине. Описание критериев и шкал оценивания результатов обучения по дисциплине. ....	5
4.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценивания результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания результатов обучения по дисциплине. ....	7
5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины.....	13
5.1. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины .....	13
5.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и программного обеспечения, необходимых для освоения дисциплины, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы .....	14
6. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине.....	15

## 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций

По итогам освоения дисциплины обучающийся должен достичь следующих результатов обучения:

Формируемая компетенция (с указанием кода)	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
ОПК-2 Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем	ОПК 2.1 Распознавать типы (классы) исследовательских задач, применять для них адекватные методы решения и современный экономико-математический и программный инструментарий	Знать: теоретические основы анализа временных рядов; суть, методологию и этапы построения моделей прогнозирования финансовых показателей; Уметь: осуществлять сбор и подготовку статистической информации для построения прогнозных эконометрических моделей; строить модели и осуществлять прогнозы, анализировать результаты моделирования финансовых показателей и делать выводы; строить прогнозную модель на основе экспоненциального сглаживания; формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей; Владеть: основами математического моделирования прикладных задач в прогнозировании; владеть навыками: построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей

## 2. Цель и место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Продвинутое инструментальные методы экономического анализа» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

Дисциплина изучается на 1 курсе при заочной форме обучения.

Цели изучения дисциплины: расширение представления о теоретических основах современных прикладных эконометрических методов анализа данных и формирование навыков применения инструментов анализа временных рядов.

## 3. Содержание рабочей программы (объем дисциплины, типы и виды учебных занятий, учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся)

Содержание рабочей программы представлено в Приложении № 1.

## 4. Фонд оценочных средств по дисциплине

**4.1. Перечень компетенций и индикаторов достижения компетенций с указанием соотнесенных с ними запланированных результатов обучения по дисциплине. Описание критериев и шкал оценивания результатов обучения по дисциплине.**

Код и формулировка компетенции ОПК-2 Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине	Критерии оценивания результатов обучения	
		Не зачтено	Зачтено
ОПК 2.1 Распознавать типы (классы) исследовательских задач, применять для них адекватные методы решения и современный экономико-математический и программный инструментарий	Знать: теоретические основы анализа временных рядов	Отсутствие или фрагментарные представления о теоретических основах анализа временных рядов	Сформированные представления о теоретических основах анализа временных рядов
	Уметь: осуществлять сбор и подготовку статистической информации для построения прогнозных эконометрических моделей; строить модели и осуществлять прогнозы, анализировать результаты моделирования финансовых показателей и делать выводы; строить прогнозную модель на основе экспоненциального сглаживания	Отсутствие или фрагментарные умения в сборе и подготовке статистической информации для построения прогнозных эконометрических моделей; построении моделей и осуществлении прогнозов	В целом студент умеет : осуществлять сбор и подготовку статистической информации для построения прогнозных эконометрических моделей; строить модели и осуществлять прогнозы, анализировать результаты моделирования финансовых показателей и делать выводы; строить прогнозную модель на основе экспоненциального сглаживания
	Владеть: основами математического моделирования прикладных задач в прогнозировании	Отсутствие или фрагментарные владение основами математического моделирования прикладных задач в прогнозировании	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы владение основами математического моделирования прикладных задач в прогнозировании

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине	Критерии оценивания результатов обучения			
		2 («Неудовлетворительно»)	3 («Удовлетворительно»)	4 («Хорошо»)	5 («Отлично»)
ОПК 2.1 Распознавать типы (классы)	Знать: суть, методiku и этапы построения моделей	Фрагментарные представления о сути, методике и этапах построения	Неполные представления о сути, методике и этапах построения моделей	Сформированные, но содержащие отдельные пробелы	Сформированные систематические представления о сути,

исследовательских задач, применять для них адекватные методы решения и современный экономико-математический и программный инструментарий	прогнозирования финансовых показателей	моделей прогнозирования финансовых показателей	прогнозирования финансовых показателей	представления о сути, методике и этапах построения моделей прогнозирования финансовых показателей	методике и этапах построения моделей прогнозирования финансовых показателей
	Уметь: формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей	Фрагментарные умения формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей	В целом успешное, но не систематическое умение формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей	Сформированное умение формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному процессу, проверять прогностическую ценность моделей
	Владеть навыками: построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей	Фрагментарное владение навыками построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей	В целом успешное, но не систематическое владение построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы владение построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей	Успешное и систематическое применение навыков построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей

**4.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценивания результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания результатов обучения по дисциплине.**

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине	Оценочные средства
ОПК 2.1 Распознавать типы (классы) исследовательских задач, применять для них адекватные методы решения и современный экономико-математический и программный инструментарий	Знать: теоретические основы анализа временных рядов; суть, методику и этапы построения моделей прогнозирования финансовых показателей	тест
	Уметь: осуществлять сбор и подготовку статистической информации для построения прогнозных эконометрических моделей; строить модели и осуществлять прогнозы, анализировать результаты моделирования финансовых показателей и делать выводы; строить прогнозную модель на основе экспоненциального сглаживания; формировать постановку модели прогнозирования на основе качественного анализа ретроспективы процесса исследования; проверять полученные прогнозные модели на адекватность реальному моделируемому процессу, проверять прогностическую ценность моделей	лабораторная работа
	Владеть: основами математического моделирования прикладных задач в прогнозировании; владеть навыками: построения адекватных математических моделей финансовых временных рядов с использованием компьютерных средств и специализированного ПО; построения прогнозов на основе моделей	экзаменационные вопросы, лабораторная работа

Изучение дисциплины предполагает самостоятельное выполнение **пяти лабораторных работы по основным изученным темам.**

На оценку степени сформированности компетенций при выполнении заданий лабораторной работы влияет полнота и правильность выполнения всех необходимых заданий (пунктов) работы.

Формы и содержание текущего контроля:

- контроль посещаемости лекционных и практических занятий;
- оценка подготовки к семинарским и практическим занятиям;
- выборочная проверка ответов на вопросы самоконтроля;
- оценка уровня развития компетенций в ходе анализа проблемных ситуаций и решения практических ситуаций.

Последовательность (этапы) решения заданий лабораторных работ:

1. Поиск репрезентативной выборки данных (временного ряда) по исследуемым финансово-экономическим показателям, удовлетворяющей основным требованиям к структуре и содержанию данных.
2. Осуществление содержательного экономического анализ ряда, визуальный анализ.
3. Оценка структуры и типа ряда.
4. Нахождение долгосрочных взаимосвязей между рядами
5. Построение модели по ряду данных, оценка адекватности модели.
6. Осуществление прогноза по модели, оценка качества прогноза

Перед проведением итогового контроля преподаватель вычисляет процент полноты и правильности выполнения лабораторных работ, соответствующих проверке сформированности каждой компетенции в ходе учебного семестра.

Оценка, полученная при ответе на экзаменационные билеты, согласовывается с оценкой за выполнение лабораторных работ. Высчитывается средний балл (оценка), который округляется до ближайшего целого значения. В случае, если за ответ на экзамене и за текущий контроль (выполнение лабораторных работ и тестирование) обучающийся получает разные оценки, а для округления среднего балла в большую сторону нет полных оснований (например, за лабораторную работу получено 4 балла, а за ответ на экзамене – 3 балла, средний балл составляет – 3,5), после ответа на вопросы билета, преподаватель может задать дополнительные вопросы, по результатам ответа на которые принимается окончательное решение об оценке.

Итоговый контроль по дисциплине «Продвинутые инструментальные методы экономического анализа» проводится в виде экзамена. Оценка проводится по четырехбалльной шкале (от 2 до 5).

Структура экзаменационного билета:

Экзаменационный билет содержит 2 вопроса.

#### Пример экзаменационного билета

Башкирский государственный университет

Институт экономики, финансов и бизнеса

Кафедра цифровой экономики и коммуникаций

Направление подготовки 38.04.08

«Финансы и кредит»

Профиль «Управление  
инновационным развитием»

Дисциплина «Финансовая аналитика и  
принятие решений в условиях  
цифровизации»

#### Экзаменационный билет № 1

1. Что такое временные ряды? Какова их связь с финансовыми показателями?
2. Адаптивные модели Хольта, Брауна и Хольта-Уинтерса.

Зав. кафедрой

Р.Х. Бахитова

#### Критерии экзаменационной оценки (в баллах):

- **5 баллов** выставляется студенту, если студент дал полные, развернутые ответы на все теоретические вопросы билета, продемонстрировал знание функциональных возможностей, терминологии, основных элементов, умение применять теоретические знания при выполнении



практических заданий. Студент без затруднений ответил на все дополнительные вопросы. Практическая часть работы выполнена полностью без неточностей и ошибок;

- **4 балла** выставляется студенту, если студент раскрыл в основном теоретические вопросы, однако допущены неточности в определении основных понятий. При ответе на дополнительные вопросы допущены небольшие неточности. При выполнении практической части работы допущены несущественные ошибки;

- **3 балла** выставляется студенту, если при ответе на теоретические вопросы студентом допущено несколько существенных ошибок в толковании основных понятий. Логика и полнота ответа страдают заметными изъянами. Заметны пробелы в знании основных методов. Теоретические вопросы в целом изложены достаточно, но с пропусками материала. Имеются принципиальные ошибки в логике построения ответа на вопрос. Студент не решил задачу или при решении допущены грубые ошибки;

- **2 балла** выставляется студенту, если ответ на теоретические вопросы свидетельствует о непонимании и крайне неполном знании основных понятий и методов. Обнаруживается отсутствие навыков применения теоретических знаний при выполнении практических заданий. Студент не смог ответить ни на один дополнительный вопрос.

Оценка, полученная при ответе на экзаменационные билеты, согласовывается с оценкой за выполнение лабораторных работ. Вычисляется средний балл (оценка), который округляется до ближайшего целого значения. В случае, если за ответ на экзамене и за текущий контроль (выполнение лабораторных работ и тестирование) обучающийся получает разные оценки, а для округления среднего балла в большую сторону нет полных оснований (например, за лабораторную работу получено 4 балла, а за ответ на экзамене – 3 балла, средний балл составляет – 3,5), после ответа на вопросы билета, преподаватель может задать дополнительные вопросы, по результатам ответа на которые принимается окончательное решение об оценке.

### **Перечень вопросов для подготовки к экзамену**

1. Прогнозирование финансовых показателей: основные понятия, предмет и методы прогнозирования.
  2. Типология прогнозов.
  3. Основные принципы и функции прогнозирования. Роль прогнозирования в принятии управленческих решений.
  4. Цели и задачи прогнозирования.
  5. Понятие метода прогнозирования. Классификация методов прогнозирования.
  6. Модели прогнозирования на основе временных рядов.
  7. Временные ряды: определения, свойства, примеры.
  8. Адаптивные методы прогнозирования.
  9. Адаптивные модели: модель Хольта.
  10. Адаптивные модели: модель Брауна.
  11. Адаптивные модели: модель Хольта-Уинтерса (аддитивная и мультипликативная).
  12. Общие положения компонентного анализа.
  13. Оценка тренда.
  14. Параметрические методы оценки тренда.
  15. Непараметрические методы оценки тренда.
  16. Учет структурных изломов при оценке тренда.
  17. Оценка сезонной компоненты.
  18. Влияние процедуры выделения тренда методом скользящих средних на сезонную компоненту.
  19. Оценка сезонной компоненты с помощью тригонометрической функции.
  20. Оценка сезонной компоненты с помощью сезонных индексов.
  21. Оценка сезонной компоненты с помощью фиктивных переменных.
  22. Понятие автокорреляционной функции и частной автокорреляционной функции.
- Примеры АКФ и ЧАКФ некоторых процессов.

23. Стационарные процессы: определения, примеры.
24. Авторегрессионные модели.
25. Методы оценивания AR-моделей.
26. Модели скользящего среднего.
27. Методы оценивания MA-моделей.
28. Модели авторегрессии скользящего среднего.
29. Идентификация моделей ARMA.
30. Модели авторегрессии проинтегрированного скользящего среднего.
31. Проверка адекватности ARMA-моделей.
32. Идентификация моделей ARIMA.
33. Прогнозирование по модели ARIMA.
34. Авторегрессионные процессы Маркова и Юла.
35. Прогнозирование тренда.
36. Прогнозирование сезонной компоненты.
37. Прогнозирование по модели ARMA.
38. Спектральный анализ Фурье. Разложение функций и временных рядов в ряды Фурье.
39. Периодограмма и спектрограмма.
40. Трудности при интерпретации спектров. Спектральные окна.
41. Различные примеры спектров случайных процессов.
42. Адекватность моделей временных рядов. Прогнозирование при компонентном анализе.
43. Общая схема прогнозирования на основе временных рядов.

**Лабораторная работа** является основной формой промежуточного контроля знаний студентов, она позволяет структурировать знания обучаемых. Это одна из форм проверки и оценки усвоенных знаний, получения информации о характере познавательной деятельности, уровня самостоятельности и активности студентов в учебном процессе, эффективности методов, форм и способов учебной деятельности. Эта форма самостоятельной работы студента выявляет умение применять теоретические знания на практике, помогает проверить усвоение курса перед экзаменом.

Цель выполняемой работы: получить специальные знания по выбранной теме.

Основные задачи выполняемой работы:

- 1) закрепление полученных ранее теоретических знаний;
- 2) выработка навыков самостоятельной работы;
- 3) выяснение подготовленности студента к будущей практической работе.

Лабораторные работы заключаются в выполнении кейс-заданий по всем изучаемым темам.

### **Примеры кейс-заданий (лабораторных работ)**

#### **Кейс-задание 1 (выполняется на лабораторной работе №1)**

Лабораторная работа №1 ***Выявление структуры финансового временного ряда на основе выделения компонент.***

1. Цели и задачи работы.
2. Описание входных данных (не менее 60 наблюдений (ежемесячные, ежеквартальные) показателей национальной экономики). Проверка качества информации согласно требованиям, предъявляемым к информационной базе прогнозирования.
3. Выдвинуть гипотезу о структуре ряда на основе визуального анализа. Сделать предположения о наличии сезонной/циклической составляющей, и о ее способе вхождения в структуру ряда (мультипликативно или аддитивно).

4. Определения наличия тренда на основе
  - 4.1. Визуального анализа графика исходных данных;
  - 4.2. Теоретических предпосылок о наличии тренда;
  - 4.3. Анализа корреллограммы АКФ;
5. Определение наличия в ряде, очищенного от тренда, сезонной/циклической компоненты на основе:
  - 5.1. Визуального анализа графика исходных данных;
  - 5.2. Теоретических предпосылок о наличии сезонности;
  - 5.3. Анализа корреллограммы АКФ ;
6. Сделать выводы о наличии детерминированных компонент в структуре ряда.

**Критерии оценивания выполнения кейс-заданий:**

Критерии оценивания	Количество баллов
Лабораторная работа подготовлена к выполнению, обучаемый знает цель лабораторной работы; задания решены без ошибок с первого раза, правильно выбраны решения заданий; правильно выполнены расчёты, обучающийся понимает, что они значат; полно даны ответы на контрольные вопросы; отчёт оформлен аккуратно, сделаны выводы.	5
Лабораторная работа подготовлена к выполнению, обучаемый знает цель лабораторной работы; задания решены с ошибками, потребовалась дополнительная помощь преподавателя, правильно выбраны методики решения заданий; расчёты выполнены с консультацией преподавателя; полно даны ответы на контрольные вопросы; отчёт оформлен аккуратно, сделаны выводы	3-4
Лабораторная работа подготовлена к выполнению, обучаемый знает цель лабораторной работы; задания выполнены с ошибками, потребовалась дополнительная помощь преподавателя, правильно выбраны методики решения заданий; с ошибками выполнены расчёты, даже с консультацией преподавателя или обучающийся не может объяснить, как выполнялись расчеты; даны ответы на контрольные вопросы	2
Лабораторная работа подготовлена к выполнению, обучаемый не знает цель лабораторной работы; задачи решены с ошибками, потребовалась дополнительная помощь преподавателя, неверно выбраны методы решения задач; не выполнены расчёты; не даны ответы на устные контрольные вопросы; отчёт оформлен небрежно, выводы не сделаны	менее 2

**Тестовые задания**

**Пример заданий для тестового контроля уровня усвоения учебного материала**

1. Процесс, при котором значение временного ряда находится в линейной зависимости от предыдущих его значений, называется:

Выберите один ответ:

- а) Автокорреляционным.
- б) Авторегрессионным
- в) Авторегрессионным процессом скользящей средней
- г) Процессом скользящей средней.

2. На основе квартальных данных о прибыли компании за 5 лет построена тренд-сезонная модель - линейный тренд и аддитивная сезонность:

квартал	1	2	3	4
---------	---	---	---	---

сезонная составляющая	-0,3	-1,15	1,2	0,25
-----------------------	------	-------	-----	------

Прогнозная оценка уровня прибыли во втором квартале следующего года равна

Выберите один ответ:

- а) 72,55
- б) 70,25
- в) 71,4
- г) 70,45

3. Модель авторегрессии скользящего среднего с введением экзогенных переменных называется:

Выберите один ответ:

- а) ARIMA
- б) ARDL
- в) ECM
- г) ARIMAX

4. Сезонную модель можно оценить с помощью:

Выберите один или несколько ответов:

- а) метода гармоник.
- б) взятия разностей различного порядка
- в) Сезонных индексов
- г) Фиктивных переменных.
- д) сезонного разложения.

5. Мультипликативная модель Хольта-Уинтерса имеет следующее число параметров адаптации:

Выберите один ответ:

- а) 1
- б) 2
- в) 3
- г) 4

6. В квадратичной модели Брауна для «обучения» параметров используется:

Выберите один ответ:

- а) Только исходные уровни значений временного ряда
- б) Исходные уровни значений временного ряда и экспоненциальные средние первого порядка
- в) Исходные уровни значений временного ряда и экспоненциальные средние первого и второго порядка
- г) Исходные уровни значений временного ряда и экспоненциальные средние первого, второго и третьего порядка

7. В модели Хольта параметры адаптации служат для:

Выберите один ответ:

- а) Сглаживания сезонности
- б) Сглаживания квадратичного тренда
- в) Сглаживания линейного тренда
- г) Сглаживания экспоненциального тренда

8. Параметры адаптации в моделях экспоненциального сглаживания могут принимать значения:

Выберите один ответ:

- а)  $(0; +\infty)$
- б)  $(-\infty; +\infty)$
- в)  $[0; 1]$
- г)  $(-1; +1)$

9. Модель Хольта-Уинтерса отличается от остальных моделей адаптивного сглаживания тем, что позволяет:

Выберите один ответ:

- а) Учесть случайность
  - б) Учесть линейный тренд
  - в) Учесть сезонность
  - г) Учесть экспоненциальный рост
10. Валидация во временных рядах означает:  
Выберите один ответ:
- а) Последовательное формирование сначала периода обучающей выборки, затем за ней тестовой выборки
  - б) Последовательное формирование сначала периода тестовой выборки, затем за ней обучающей выборки
  - в) Случайное формирование выборки на обучающую и тестовую выборку

**Критерии оценивания выполнения тестового контроля:**

Процент правильных ответов	Количество баллов
80-100 %	5
60-79%	4
50-59%	3
менее 50%	2

**5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины**

**5.1. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины**

**Основная литература:**

1. Эконометрика : учебник / В.С. Мхитарян, М.Ю. Архипова, В.А. Балаш и др. ; под ред. В.С. Мхитаряна. - Москва : Проспект, 2014. - 384 с. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-392-13469-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=251664>.
2. Путко, Б.А. Эконометрика : учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер ; ред. Н.Ш. Кремера. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>.
3. Мхитарян, В.С. Эконометрика : учебно-практическое пособие / В.С. Мхитарян, М.Ю. Архипова, В.П. Сиротин. - Москва : Евразийский открытый институт, 2012. - 221 с. - ISBN 978-5-374-00053-5 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=90911>.
4. Эконометрика : учебник / К.В. Балдин, В.Н. Башлыков, Н.А. Брызгалов и др. ; под ред. В.Б. Уткина. - 2-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. - 562 с. : ил. - Библиогр.: с. 473-477. - ISBN 978-5-394-02145-9 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=452991>.
5. Грибанова, Е.Б. Эконометрика : учебное пособие / Е.Б. Грибанова ; Министерство образования и науки Российской Федерации, Томский Государственный Университет Систем Управления и Радиоэлектроники (ТУСУР). - Томск : ТУСУР, 2014. - 156 с. : схем. - Библиогр.: с. 132. ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=480470>.

**Дополнительная литература:**

6. Эконометрика : практикум / сост. В.А. Молодых, А.А. Рубежной, А.И. Сосин ; Министерство образования и науки Российской Федерации и др. - Ставрополь : СКФУ, 2016.

- 157 с. : ил. - Библиогр. в кн. ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=458941>.

7. Герасимов, А.Н. Эконометрика: продвинутый уровень : учебное пособие / А.Н. Герасимов, Е.И. Громов, Ю.С. Скрипниченко ; Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего профессионального образования Ставропольский государственный аграрный университет. - Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2016. - 272 с. : ил. - Библиогр.: с. 260-261. ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=484978>.

8. Яковлев, В.П. Эконометрика : учебник / В.П. Яковлев. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 384 с. : ил. - (Учебные издания для бакалавров). - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02532-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=453368>.

## **5.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и программного обеспечения, необходимых для освоения дисциплины, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

Пользователям библиотеки БашГУ предоставляется возможность использования следующих электронных информационных ресурсов:

№	Наименование Интернет-ресурса	Ссылка (URL) на Интернет ресурс
1.	Федеральная служба государственной статистики	<a href="http://www.gks.ru">www.gks.ru</a>
2.	Министерство финансов РФ	<a href="http://www.minfin.ru">www.minfin.ru</a>
3.	Международный валютный фонд	<a href="http://www.imf.org">www.imf.org</a>
4.	Центр макроэкономического анализа и краткосрочного прогнозирования	<a href="http://www.forecast.ru">www.forecast.ru</a>
5.	Территориальный орган Федеральной службы государственной статистики по РБ	<a href="http://www.bashstat.ru">www.bashstat.ru</a>
6.	Информационно-издательский центр «Статистика России»	<a href="http://www.infostat.ru">www.infostat.ru</a>
7.	Информационно-аналитический сайт в области информационных технологий	citforum.ru
8.	Издание о высоких технологиях	cnews.ru
9.	Библиотека Г. Верникова – все о менеджменте и ИТ - подборка аналитических материалов по вопросам экономики, менеджмента и информационных технологий.	vernikov.ru
10.	Официальный портал ИТ-директоров (Реестр ИТ-поставщиков)	globalcio.ru
11.	Журнал СІО – руководитель информационной службы	cio-world.ru
12.	Электронно-библиотечная система	ZNANIUM.COM
13.	Единый архив экономических и социологических данных ВШЭ	<a href="http://sophist.hse.ru/">http://sophist.hse.ru/</a>

1. База данных периодических изданий на платформе EastView: «Вестники Московского университета», «Издания по общественным и гуманитарным наукам» - <https://dlib.eastview.com/>
2. Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» - <http://window.edu.ru>
3. Научная электронная библиотека eLibrary.ru - <http://elibrary.ru/defaultx.asp>
4. Справочно-правовая система Консультант Плюс - <http://www.consultant.ru/>
5. Электронная библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» – <https://biblioclub.ru/>
6. Электронная библиотечная система «ЭБ БашГУ» – <https://elib.bashedu.ru/>
7. Электронная библиотечная система издательства «Лань» – <https://e.lanbook.com/>
8. Электронный каталог Библиотеки БашГУ – <http://www.bashlib.ru/catalogi>.
9. Архивы научных журналов на платформе НЭИКОН (Cambridge University Press, SAGE Publications, Oxford University Press) - <https://archive.neicon.ru/xmlui/>
10. Издательство «Annual Reviews» - <https://www.annualreviews.org/>
11. Издательство «Taylor&Francis» - <https://www.tandfonline.com/>
12. Windows 8 Russian. Windows Professional 8 Russian Upgrade Договор №104 от 17.06.2013 г. Лицензии бессрочные.
13. Microsoft Office Standard 2013 Russian. Договор №114 от 12.11.2014 г. Лицензии бессрочные.
14. Windows 8 Russian. Windows Professional 8 Russian Upgrade. Договор № 104 от 17.06.2013 г. Лицензии бессрочные.

**6. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

Наименование специализированных аудиторий, кабинетов, лабораторий	Вид занятий	Наименование оборудования, программного обеспечения
1	2	3
<p><b>Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа:</b> аудитория № 110 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 111 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 301 (гуманитарный корпус), аудитория № 305 (гуманитарный корпус), аудитория № 307 (гуманитарный корпус), аудитория № 308 (гуманитарный корпус), аудитория № 309 (гуманитарный корпус).</p>	Лекции	Учебная мебель, доска, проекционный экран, проектор, персональные компьютеры. Office Standard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition
<p><b>Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа:</b> лаборатория социально-экономического моделирования № 107 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), лаборатория анализа данных № 108 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 110 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 111 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 114 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 122 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 204 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 207 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 208 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 209 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 210 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 212 (гуманитарный корпус), аудитория № 213 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 218 (гуманитарный корпус), аудитория № 220 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 221 (гуманитарный корпус), аудитория № 222 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 301 (гуманитарный корпус), аудитория № 305 (гуманитарный корпус), аудитория № 307 (гуманитарный корпус), аудитория № 308 (гуманитарный корпус), аудитория № 309 (гуманитарный корпус), лаборатория исследования процессов в экономике и управлении № 311а (гуманитарный корпус), лаборатория информационных технологий в экономике и управлении № 311в (гуманитарный корпус).</p>	Практические (семинарские) занятия	Учебная мебель, доска, проекционный экран, проектор, персональные компьютеры. Office Standard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition
<p><b>Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций:</b> лаборатория социально-экономического моделирования № 107 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), лаборатория анализа данных № 108 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 110 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 111 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 114 (помещение, ул.Карла</p>	Групповые и индивидуальные консультации,	Учебная мебель, доска, проекционный экран, проектор, персональные компьютеры. Office Standard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition



<p>Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 122 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 204 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 207 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 208 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 209 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 210 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 212 (гуманитарный корпус), аудитория № 213 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 218 (гуманитарный корпус), аудитория № 220 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 221 (гуманитарный корпус), аудитория № 222 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 301 (гуманитарный корпус), аудитория № 305 (гуманитарный корпус), аудитория № 307 (гуманитарный корпус), аудитория № 308 (гуманитарный корпус), аудитория № 309 (гуманитарный корпус), лаборатория исследования процессов в экономике и управлении № 311а (гуманитарный корпус), лаборатория информационных технологий в экономике и управлении № 311в (гуманитарный корпус).</p>		
<p><b>Учебная аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации:</b> лаборатория социально-экономического моделирования № 107 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), лаборатория анализа данных № 108 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 110 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 111 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 114 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 122 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 204 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 207 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 208 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 209 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 210 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 212 (гуманитарный корпус), аудитория № 213 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 218 (гуманитарный корпус), аудитория № 220 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 221 (гуманитарный корпус), аудитория № 222 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4), аудитория № 301 (гуманитарный корпус), аудитория № 305 (гуманитарный корпус), аудитория № 307 (гуманитарный корпус), аудитория № 308 (гуманитарный корпус), аудитория № 309 (гуманитарный корпус), лаборатория исследования процессов в экономике и управлении № 311а (гуманитарный</p>	<p>Текущий контроль и промежуточная аттестация</p>	<p>Учебная мебель, доска, проекционный экран, проектор, персональные компьютеры. Office Standard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition</p>

корпус), лаборатория информационных технологий в экономике и управлении № 311в (гуманитарный корпус).		
<b>Помещения для самостоятельной работы:</b> 302 читальный зал (гуманитарный корпус).	Самостоятельная работа	Учебная мебель, персональные компьютеры в комплекте HP, моноблок, персональный компьютер в комплекте моноблок iRU.
<b>Помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования:</b> аудитория № 115 (помещение, ул. Карла Маркса, д.3, корп.4), 118 (помещение, ул.Карла Маркса, д.3, корп.4)	Хранение и профилактическое обслуживание учебного оборудования	Учебная мебель, колонки (2 шт.), динамики, dvd плеер toshiba, магнитола sony (4 шт.).

ФГБОУ ВО «БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, ФИНАНСОВ И БИЗНЕСА

**СОДЕРЖАНИЕ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

дисциплины «Продвинутые инструментальные методы экономического анализа»  
на установочную сессию  
заочная форма обучения

<b>Вид работы</b>	<b>Объем дисциплины</b>
Общая трудоемкость дисциплины (з.е. / часов)	2/72
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	2
практических/ семинарских	6
лабораторных	2
других (групповая, индивидуальная консультация и иные виды учебной деятельности, предусматривающие работу обучающихся с преподавателем) (ФКР)	
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	62
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на подготовку к экзамену/зачету/дифференцированному зачету (Контроль)	

Форма(ы) контроля:

	Тема и содержание	Форма изучения материалов: лекции, практические / семинарские занятия, лабораторные работы, самостоятельная работа и трудоемкость (в часах)				Задания по самостоятельной работе студентов	Форма текущего контроля успеваемости (коллоквиумы, контрольные работы, компьютерные тесты и т.п.)
		ЛК	ПР/СЕМ	ЛР	СР		
1.	Введение в анализ финансовых временных рядов	1			15	Вопросы для самостоятельной работы	Проверка ответов на вопросы, тестирование
2.	Методы и принципы анализа оценки структуры временного ряда финансовых показателей. АКФ	1		2	15	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 1	Проверка выполнения задачи-кейса 1; тестирование
3.	Моделирование тренда		1	2	16	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 2	Проверка выполнения задачи-кейса 2; тестирование
4.	Моделирование сезонной компоненты		1	2	16	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 3	Проверка выполнения задачи-кейса 3; тестирование
	<b>Всего часов:</b>	<b>2</b>	<b>2</b>	<b>6</b>	<b>62</b>		

ФГБОУ ВО «БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, ФИНАНСОВ И БИЗНЕСА

**СОДЕРЖАНИЕ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

дисциплины «Продвинутые инструментальные методы экономического анализа»  
на зимнюю сессию  
заочная форма обучения

<b>Вид работы</b>	<b>Объем дисциплины</b>
Общая трудоемкость дисциплины (з.е. / часов)	2/72
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	2
практических/ семинарских	2
лабораторных	6
других (групповая, индивидуальная консультация и иные виды учебной деятельности, предусматривающие работу обучающихся с преподавателем) (ФКР)	0,2
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	57,8
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на подготовку к экзамену/зачету/дифференцированному зачету (Контроль)	

Форма(ы) контроля:

Зачет в зимнюю сессию

	Тема и содержание	Форма изучения материалов: лекции, практические / семинарские занятия, лабораторные работы, самостоятельная работа и трудоемкость (в часах)				Задания по самостоятельной работе студентов	Форма текущего контроля успеваемости (коллоквиумы, контрольные работы, компьютерные тесты и т.п.)
		ЛК	ПР/СЕМ	ЛР	СР		
5.	Общие положения адаптивных методов прогнозирования финансовых показателей. Порядок построения модели	1	1		18	Вопросы для самостоятельной работы	Проверка ответов на вопросы, тестирование
6.	Построение адаптивных моделей, оценка адекватности модели и прогнозирование	1	1	6	18	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 4	Проверка выполнения задачи-кейса 4; тестирование
	<b>Всего часов:</b>	<b>2</b>	<b>2</b>	<b>6</b>	<b>57,8</b>		

ФГБОУ ВО «БАШКИРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

ИНСТИТУТ ЭКОНОМИКИ, ФИНАНСОВ И БИЗНЕСА

**СОДЕРЖАНИЕ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

дисциплины «Продвинутые инструментальные методы экономического анализа»  
на летнюю сессию  
заочная форма обучения

<b>Вид работы</b>	<b>Объем дисциплины</b>
Общая трудоемкость дисциплины (з.е. / часов)	2/72
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	2
практических/ семинарских	
лабораторных	4
других (групповая, индивидуальная консультация и иные виды учебной деятельности, предусматривающие работу обучающихся с преподавателем) (ФКР)	1,2
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	55,8
из них, предусмотренные на выполнение курсовой работы / курсового проекта	
Учебных часов на подготовку к экзамену/зачету/дифференцированному зачету (Контроль)	9

Форма(ы) контроля:  
Экзамен летняя сессия

	Тема и содержание	Форма изучения материалов: лекции, практические / семинарские занятия, лабораторные работы, самостоятельная работа и трудоемкость (в часах)				Задания по самостоятельной работе студентов	Форма текущего контроля успеваемости (коллоквиумы, контрольные работы, компьютерные тесты и т.п.)
		ЛК	ПР/СЕМ	ЛР	СР		
7.	Моделирование структурных сдвигов. Тест Чоу. Тест Квандта – Эндрюса.	1		2	27,8	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 5	Проверка выполнения задачи-кейса 5; тестирование
8.	Модели стационарных временных рядов (SARMA) Стационарность процессов. Определение порядка интегрируемости ARIMA- моделей, порядков $p$ и $q$ моделей авторегрессии и скользящего среднего с помощью анализа коррелограмм и критерия Лjung-Бокса. Единичные корни модели. Критерии оценки качества модели: критерии Акаике, Шварца, Ханна-Квина	1		2	28	Изучение теоретического материала, подготовка отчета по выполненному кейсу 6	Проверка выполнения задачи-кейса 6; тестирование
	Всего часов:	2		4	55,8		