

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич  
Должность: врио ректора  
Дата подписания: 05.10.2025 16:24:05  
Уникальный программный ключ:  
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf35f08

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

Утверждаю:  
Руководитель ООП  
С.М. Дудаков  
«25» января 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.**