



## СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «Фінансова економетрика»

Рівень вищої освіти – другий (магістерський)  
Спеціальність 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок»  
Освітньо-професійна програма «Фінанси і кредит»  
Рік навчання 1, семестр 2  
Форма навчання денна, заочна  
Кількість кредитів ЄКТС 5  
Мова викладання українська  
Д.е.н., професор Негода Юлія Володимирівна  
e-mail [negoda\\_y@nubip.edu.ua](mailto:negoda_y@nubip.edu.ua)  
тел. +380675223566  
<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=1476>

Лектор курсу

Контактна інформація  
лектора (e-mail)

Сторінка курсу в eLearn

### ОПИС ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна передбачає формування у студентів системи знань з математичних методів і в набутті теоретичних основ і практичних навичок з питань постановки, розв'язання оптимізаційних та управлінських задач економіки інструментарієм математичних методів, а також вивчення методів побудови адекватних економетричних моделей та прогнозу поведінки реальних економічних процесів на підставі використання сучасних програмних заходів.

#### **Інтегральна компетентність (ІК):**

Здатність розв'язувати складні завдання та проблеми у процесі професійної, навчальної і дослідницької діяльності у галузі фінансів, банківської справи, страхування та фондового ринку.

#### **загальні компетентності (ЗК):**

ЗК1. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК5. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

#### **фахові (спеціальні) компетентності (СК):**

СК6. Здатність застосовувати міждисциплінарні підходи при розв'язанні складних задач і проблем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК7. Здатність до пошуку, використання та інтерпретації інформації, необхідної для вирішення професійних і наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

#### **програми результати навчання (ПР):**

ПР1. Використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності.

ПР8. Вміти застосовувати інноваційні підходи у сфері фінансів, банківської справи та страхування та управляти ними.

### СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години (лекції/практ., сем.)	Результати навчання	Завдання	Оцінювання
<b>1 семестр</b>				
<b>Модуль 1 «Теоретичні основи фінансової економетрики»</b>				<b>100</b>
Фінансова економетрика: основні поняття і визначення	2/5	Знати принципи кількісного аналізу реальних економічних процесів і явищ у часі й у просторі; одержати знання по емпіричному виведенню економічних залежностей, закономірностей і законів, що діють у цей час.	Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	<i>Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.</i>
Програмне забезпечення для моделювання та Data Mining	3/5		Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	<i>Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.</i>
<b>Модуль 2. «Прогнозування в фінансовій економетриці»</b>				<b>100</b>
Основні методи прогнозування	2/5	Використовувати методи економетричного аналізу факторних ефектів, кластерного аналізу та факторного аналізу для	Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	<i>Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв</i>

		дослідження фінансової діяльності підприємств, регіональних та державних фінансів. Вміти застосовувати методи прогнозування.		оцінювання в eLearn.
Лінійна регресія в фінансових розрахунках	3/5		Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.
<b>Модуль 3. «Прогнозна аналітика»</b>				<b>100</b>
Введення в прогнозу аналітику	2/5	Вміти будувати й використовувати економетричні моделі, а також оцінювати їхні параметри для пояснення поведінки досліджуваних економічних явищ.	Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.
Аналітика часових рядів	3/5	Вміти перевіряти висунуті гіпотези про властивості економічних показників і форми їхнього зв'язку.	Здача практичних робіт. Написання тестів, ессе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в elearn)	Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.
<b>Всього за 1 семестр</b>				<b>70</b>
<b>Екзамен</b>				<b>30</b>
<b>Всього за курс</b>				<b>100</b>

### ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

<b>Політика щодо дедлайнів та перекладання:</b>	Роботи, які здаються із порушенням термінів без поважних причин, оцінюються на нижчу оцінку. Перекладання модулів відбувається із дозволу лектора за наявності поважних причин (наприклад, лікарняний).
<b>Політика щодо академічної доброчесності:</b>	Списування під час контрольних робіт та екзаменів заборонені (в т.ч. із використанням мобільних девайсів). Курсові роботи, реферати повинні мати коректні текстові посилання на використану літературу.
<b>Політика щодо відвідування:</b>	Відвідування занять є обов'язковим. За об'єктивних причин (наприклад, хвороба, міжнародне стажування) навчання може відбуватись індивідуально (в он-лайн формі за погодженням із деканом факультету та лектором)

### ШКАЛА ОЦІНЮВАННЯ СТУДЕНТІВ

Рейтинг здобувача вищої освіти, бали	Оцінка національна за результати складання екзаменів заліків	
	екзаменів	заліків
90-100	відмінно	зараховано
74-89	добре	
60-73	задовільно	
0-59	незадовільно	не зараховано

### РЕКОМЕНДОВАНІ ДЖЕРЕЛА ІНФОРМАЦІЇ

- Негода Ю.В., Титарчук І.М. Методичні вказівки до вивчення дисципліни «Фінансова економетрика» для здобувачів другого (магістерського) рівня спеціальності 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок» освітньо-професійної програми «Фінанси і кредит». К., 2023. 44 с.
- Назаренко А.М. Основи економетрики : Підручник .К.: Центр навчальної літератури, 2014. 392 с.
- Лук'яненко І.Г., Жук В.М. Аналіз часових рядів. Частина 1: Побудова ARIMA, ARCH / GARCH моделей, використовуючи пакет E.Views 6.0. Практичний посібник для роботи в комп'ютерному класі К.: НАУКМА; АгроМедіаГруп, 2017. 187 с. <http://www.ekmair.ukma.edu.ua/handle/123456789/9085>
- C.W.J. Granger, Paul Newbold. Forecasting Economic Time Series. Academic Press, 2014.
- Höchstötter, M., Arshanapalli, B., Rachev, S., Fabozzi, F., Focardi, S. (2014). The Basics of Financial Econometrics: Tools, Concepts, and Asset Management Applications. (n.p.): John Wiley & Sons.
- Gourieroux, C., Jasiak, J. (2022). Financial Econometrics: Problems, Models, and Methods. Велика Британія: Princeton University Press.
- Cipra, T. (2020). Time Series in Economics and Finance. Німеччина: Springer International Publishing.
- Handbook of Blockchain, Digital Finance, and Inclusion, Volume 1: Cryptocurrency, FinTech, InsurTech, and Regulation. (2017). Велика Британія: Elsevier Science.
- Box G.E., Jenkins G.M., Reinsel G.C., Ljung G.M. Time series analysis: forecasting and control. John Wiley & Sons, 2015.
- Asteriou D., Stephen G. Hall. Applied econometrics. Palgrave Macmillan, 2015.

*Інформаційні ресурси*

1. Офіційний веб-портал Верховної Ради України. URL: <https://www.rada.gov.ua/>
2. Офіційний веб-портал Національного банку України. URL: <https://bank.gov.ua/>
3. Офіційний веб-портал Міністерства юстиції України. URL: <https://minjust.gov.ua/>
4. Офіційний веб-портал Міністерства цифрової трансформації України. URL: <https://thedigital.gov.ua/>
5. Офіційний веб-портал Національної комісії з цінних паперів та фондових ринків. URL: <https://www.nssmc.gov.ua/>
6. Офіційний веб-портал Державної служби фінансового моніторингу України. URL: <https://fiu.gov.ua/>
7. Офіційний веб-портал Державної казначейської служби України. URL: <https://www.treasury.gov.ua/>
8. Офіційний веб-сайт Міністерства фінансів України. URL: <https://www.mof.gov.ua/uk>