

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І  
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ**

**Кафедра фінансів**

«ЗАТВЕРДЖУЮ»  
Декан економічного факультету  
\_\_\_\_\_ Анатолій ДІБРОВА  
“16” травня 2024 р.

«СХВАЛЕНО»  
на засіданні кафедри фінансів  
Протокол №13 від “16” травня 2024 р.  
Завідувача кафедри фінансів  
\_\_\_\_\_ Наталія ШВЕЦЬ

«РОЗГЛЯНУТО»  
Гарант ОП «Фінанси і кредит»  
\_\_\_\_\_ Руслана ОПАЛЬЧУК

**РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ**

**ФІНАНСОВА ЕКОНОМЕТРИКА**

(назва навчальної дисципліни)

Галузь знань 07 «Управління та адміністрування»

Спеціальність – 072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок»

Освітня програма – «Фінанси і кредит»

Факультет економічний

Розробник – д.е.н., професор, професор кафедри фінансів Негода Ю.В.

Київ – 2024 р.

# 1. Опис навчальної дисципліни ФІНАНСОВА ЕКОНОМЕТРИКА

(назва)

<b>Галузь знань, спеціальність, освітня програма, освітній ступінь</b>		
Освітній ступінь	Магістр	
Спеціальність	072 «Фінанси, банківська справа, страхування та фондовий ринок»	
Освітня програма	«Фінанси і кредит»	
<b>Характеристика навчальної дисципліни</b>		
Вид	вибіркова	
Загальна кількість годин	150	
Кількість кредитів ECTS	5	
Кількість змістових модулів	3	
Форма контролю	екзамен	
<b>Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм здобуття вищої освіти</b>		
	Денна форма здобуття вищої освіти	Заочна форма здобуття вищої освіти
Курс (рік підготовки)	___1___	___1___
Семестр	___2___	___2___
Лекційні заняття	15 год.	___4 год.
Практичні, семінарські заняття	30 год.	6 год.
Самостійна робота	105 год.	140 год.
Кількість тижневих аудиторних годин для денної форми здобуття вищої освіти	3 год.	

## **1. Мета, завдання, компетентності та програмні результати навчальної дисципліни**

Метою вивчення курсу дисципліни “Фінансова економетрика” є 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.

Завдання курсу:

- вивчити 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;
- навчитися будувати й використовувати економетричні моделі, а також оцінювати їхні параметри для пояснення поведінки досліджуваних економічних явищ;
- перевіряти висунуті гіпотези про властивості економічних показників і форми їхнього зв'язку;
- навчитися оцінювати й використовувати результати економічного аналізу для прогнозу й прийняття обґрунтованих економічних рішень.

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

Здатність розв’язувати складні задачі і проблеми у професійній діяльності або у процесі навчання у сфері фінансів, банківської справи та страхування, що передбачає проведення досліджень та/або здійснення інновацій та характеризується невизначеністю умов і вимог.

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

ЗК 03. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні.

ЗК 05. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

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

СК 04. Здатність оцінювати дієвість наукового, аналітичного і методичного інструментарію для обґрунтування управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК 09. Здатність розробляти технічні завдання для проектування інформаційних систем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

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

ПР 06. Доступно і аргументовано представляти результати досліджень усно і письмово, брати участь у фахових дискусіях.

ПР 10. Здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб’єктів господарювання.

## 2. Програма та структура навчальної дисципліни для:

– повного терміну денної (заочної) форми здобуття вищої освіти

Назви змістових модулів і тем	Тижні	Кількість годин											
		денна форма					Заочна форма						
		усього	у тому числі				усього	у тому числі					
			л	п	лаб	інд		с.р.	л	п	лаб	інд	с.р.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
<b>Змістовий модуль 1. «Теоретичні основи фінансової економетрики»</b>													
Тема 1. Фінансова економетрика: основні поняття і визначення		25	2	5			18	9	1				25
Тема 2. Програмне забезпечення для моделювання та Data Mining		25	3	5			17	9	1				25
<b>Разом за змістовим модулем 1</b>		<b>50</b>	<b>5</b>	<b>10</b>			<b>35</b>	<b>39</b>	<b>2</b>	<b>2</b>			<b>50</b>
<b>Змістовий модуль 2. «Прогнозування в фінансовій економетриці»</b>													
Тема 3. Основні методи прогнозування		25	2	5			18	12	1				20
Тема 4. Лінійна регресія в фінансових розрахунках		25	3	5			17	13	1				20
<b>Разом за змістовним модулем 2</b>		<b>50</b>	<b>5</b>	<b>10</b>			<b>35</b>	<b>38</b>	<b>2</b>	<b>1</b>			<b>40</b>
<b>Змістовий модуль 3. «Прогнозна аналітика»</b>													
Тема 5. Введення в прогнозу аналітику		25	2	5			18	10					25
Тема 6. Аналітика часових рядів		25	3	5			17	11		1			25
<b>Разом за змістовим модулем 3</b>		<b>50</b>	<b>5</b>	<b>10</b>			<b>35</b>	<b>43</b>		<b>3</b>			<b>50</b>
<b>Усього годин</b>		<b>150</b>	<b>15</b>	<b>30</b>			<b>105</b>	<b>150</b>	<b>4</b>	<b>6</b>			<b>140</b>

### 3. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Фінансова економетрика: основні поняття і визначення	5
2	Програмне забезпечення для моделювання та Data Mining	5
3	Основні методи прогнозування	5
4	Лінійна регресія в фінансових розрахунках	5
5	Введення в прогнозу аналітику	5
6	Аналітика часових рядів	5

#### 4. Теми самостійної роботи

№ з/п	Назва теми	Кількість годин
1	Фінансова економетрика: основні поняття і визначення	18
2	Програмне забезпечення для моделювання та Data Mining	17
3	Основні методи прогнозування	18
4	Лінійна регресія в фінансових розрахунках	17
5	Введення в прогнозу аналітику	18
6	Аналітика часових рядів	17

#### 5. Засоби діагностики результатів навчання:

- екзамен;
- модульні тести;
- розрахункові та розрахунково-графічні роботи.

#### 6. Методи навчання:

- словесний метод (лекція, дискусія, співбесіда тощо);
- практичний метод (лабораторні, практичні заняття);
- наочний метод (метод ілюстрацій, метод демонстрацій);
- робота з навчально-методичною літературою (конспектування, тезування, анотування, рецензування, складання реферату);
- самостійна робота (виконання завдань).

#### 7. Методи оцінювання.

- екзамен;
- усне або письмове опитування;
- модульне тестування;
- командні проекти;
- захист лабораторних та практичних робіт.

**8. Розподіл балів**, які отримують здобувачі вищої освіти. Оцінювання знань здобувача вищої освіти відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національні оцінки згідно з табл. 1 чинного «Положення про екзамени та заліки у НУБіП України»

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

Для визначення рейтингу здобувача вищої освіти із засвоєння дисципліни  $R_{\text{дис}}$  (до 100 балів) одержаний рейтинг з атестації (до 30 балів) додається до рейтингу здобувача вищої освіти з навчальної роботи  $R_{\text{нр}}$  (до 70 балів):  $R_{\text{дис}} = R_{\text{нр}} + R_{\text{ат}}$ .

## 9. Навчально-методичне забезпечення

- електронний навчальний курс навчальної дисципліни «Фінансова економетрика» (на навчальному порталі НУБіП України eLearn - <https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=1476>);
- 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.

## 10. Рекомендовані джерела інформації

1. Назаренко А.М. Основи економетрики : підруч. Київ : Центр навчальної літератури, 2014. 392 с.
2. 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. URL : <http://www.ekmair.ukma.edu.ua/handle/123456789/9085>
3. C.J. Granger, Paul Newbold. Forecasting Economic Time Series. Academic Press, 2014. 148 p.
4. Gouriéroux C., Jasiak J. Financial Econometrics: Problems, Models, and Methods. United Kingdom : Princeton University Press, 2022. 528 p.
5. David Lee Kuo Chuen, Robert H. Deng. Handbook of Blockchain, Digital Finance, and Inclusion, Volume 1 : Cryptocurrency, FinTech, InsurTech, and Regulation (2nd Edition). United Kingdom : Elsevier Science, 2024. 522 p.
6. Box G.E., Jenkins G.M., Reinsel G.C., Ljung G.M. Time series analysis: forecasting and control. John Wiley & Sons, 2015. 232 p.
7. Chris Brooks. Introductory Econometrics for Finance. 3rd Ed. Cambridge University Press. 2019. 724 p.
8. Офіційний веб-портал Національного банку України. URL : <https://bank.gov.ua/>
9. Офіційний веб-портал Міністерства цифрової трансформації України. URL : <https://thedigital.gov.ua/>
10. Офіційний веб-портал Національної комісії з цінних паперів та фондових ринків. URL : <https://www.nssmc.gov.ua/>
11. Офіційний веб-портал Державної служби фінансового моніторингу України. URL : <https://fuu.gov.ua/>
12. Офіційний веб-портал Державної казначейської служби України. URL : <https://www.treasury.gov.ua/>
13. Офіційний веб-сайт Міністерства фінансів України. URL : <https://www.mof.gov.ua/uk>
14. Офіційний веб-портал Державної казначейської служби України. URL: <https://www.treasury.gov.ua/>