



СИЛАБУС ДИСЦИПЛІНИ «Фінансова економетрика»

Рівень вищої освіти – Магістр
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**

Лектор курсу
Контактна інформація
лектора (e-mail)
Сторінка курсу в eLearn

Д.е.н., професор Негода Юлія Володимирівна
e-mail negoda_y@nubip.edu.ua
тел. +380675223566
<https://elearn.nubip.edu.ua/course/view.php?id=1476>

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 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 010. Здійснювати діагностику і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання.

СТРУКТУРА КУРСУ

Тема	Години (лекції/практ., сем.)	Результати навчання	Завдання	Оцінювання
1 семестр				
Модуль 1 «Теоретичні основи фінансової економетрики»				100
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, есе. 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, есе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в eLearn)	<i>Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.</i>

Модуль 2. «Прогнозування в фінансовій економетриці»			100
Основні методи прогнозування	2/5	Використовувати методи економетричного аналізу факторних ефектів, кластерного аналізу та факторного аналізу для дослідження фінансової діяльності підприємств, регіональних та державних фінансів. Вміти застосовувати методи прогнозування.	Здача практичних робіт. Написання тестів, есе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в eLearn). Здача практичних робіт. Написання тестів, есе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в eLearn).
Лінійна регресія в фінансових розрахунках	3/5		<i>Розподіл балів за видами робіт відповідно до критеріїв оцінювання в eLearn.</i>
Модуль 3. «Прогнозна аналітика»			100
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, есе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. 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, есе. Розв'язок задач. Виконання самостійної роботи (в т.ч. в eLearn).
Всього за 1 семестр			70
Екзамен			30
Всього за курс			100

ПОЛІТИКА ОЦІНЮВАННЯ

Політика щодо дедлайнів та перекладання:	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).
Політика щодо академічної доброчесності:	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.
Політика щодо відвідування:	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 : підруч. Київ : 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. URL : <http://www.ekmair.ukma.edu.ua/handle/123456789/9085>
- C.J. Granger, Paul Newbold. Forecasting Economic Time Series. Academic Press, 2014. 148 p.

5. Gourieroux C., Jasiak J. Financial Econometrics: Problems, Models, and Methods. United Kingdom : Princeton University Press, 2022. 528 p.
6. 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.
7. Box G.E., Jenkins G.M., Reinsel G.C., Ljung G.M. Time series analysis: forecasting and control. John Wiley & Sons, 2015. 232 p.
8. Chris Brooks. Introductory Econometrics for Finance. 3rd Ed. Cambridge University Press. 2019. 724 p.
9. Офіційний веб-портал Національного банку України. URL : <https://bank.gov.ua/>
10. Офіційний веб-портал Міністерства цифрової трансформації України. URL : <https://thedigital.gov.ua/>
11. Офіційний веб-портал Національної комісії з цінних паперів та фондових ринків. URL : <https://www.nssmc.gov.ua/>
12. Офіційний веб-портал Державної служби фінансового моніторингу України. URL : <https://fiu.gov.ua/>
13. Офіційний веб-портал Державної казначейської служби України. URL : <https://www.treasury.gov.ua/>
14. Офіційний веб-сайт Міністерства фінансів України. URL : <https://www.mof.gov.ua/uk>