

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«САХАЛИНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**Аннотация рабочей программы дисциплины
Б1.В.ДВ.09.02 «Экономический анализ временных рядов»
направление подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит»**

1. Цели освоения дисциплины

Дать базовые теоретические знания, практические умения для понимания теории временных рядов и навыки ее применения в прикладных экономических исследованиях; ознакомить с основными моделями и методами исследования циклической динамики экономических процессов, построения прогнозов, формирование навыков построения эконометрических моделей, расчета прогнозов и интерпретации результатов, а также подготовки содержательных расчетов.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина Б1.В.ДВ.09.02 «Экономический анализ временных рядов» относится к дисциплинам по выбору основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит».

Дисциплина осваивается на 5 семестре (очной формы обучения). Трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы.

Для успешного освоения дисциплины студенты должны владеть методами математического анализа, линейной алгебры, приемами и методами эконометрических исследований, владеть компьютерными технологиями.

3. Требования к результатам освоения содержания дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению:

– способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);

– способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты (ПК-4).

В результате изучения дисциплины студент должен:

Знать:

– базовые понятия теории временных рядов и основы многомерного статистического анализа;

– методы моделирования стационарных процессов, спектральную теорию, экономические фильтры;

– основные приемы оценивания коэффициентов регрессии в нестандартных ситуациях (спецификация переменных в уравнениях регрессии, замещающие и фиктивные переменные, последствия невыполнения условий Гаусса-Маркова и их устранение, применение регрессионного анализа для оценивания систем уравнений).

Уметь:

– строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;

– прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей поведение экономических объектов, развитие экономических процессов и явлений, на

микро- и макроуровне;

– применять методы математической статистики для проверки гипотез о свойствах построенных моделей.

Владеть:

– навыками применения статистических методов для исследования циклической динамики экономических процессов, реализованных в различных статистических пакетах;

– инструментарием по моделированию и прогнозированию временных рядов в статистических пакетах.

4. Структура дисциплины «Экономический анализ временных рядов»

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы, 72 часов, очная форма обучения

№ п/п	Разделы дисциплины	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)
			Лекции	Практика	СРС	Всего	
1	Теория временных рядов в экономических исследованиях	5	2	2	4	8	практикум, тестирование, опрос
2	Основные определения и понятия теории временных рядов	5	2	2	4	8	практикум, тестирование, опрос
3	Типы моделей временных рядов и их идентификация	5	3	3	6	12	практикум, тестирование, опрос
4	Линейные модели стационарных временных рядов	5	3	3	6	12	практикум, тестирование, опрос
5	Основные типы трендов и их распознавание	5	4	4	8	16	практикум, тестирование, контр/р
6	Информационные технологии в эконометрических исследованиях	5	4	4	8	16	практикум, тестирование, проектная работа
	Итого:		18	18	36	72	зачет

5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

а) основная литература:

1. Садовникова Н.А. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебное пособие/ Садовникова Н.А., Шмойлова Р.А.– М.: Евразийский открытый институт, 2016. – 260 с.

2. Воловиков С.А. Экономические прогнозы по временным рядам: учебное пособие/ Воловиков С.А.– М.: Московский городской педагогический университет, 2015. – 34 с.

3. Кремер Н.Ш. Эконометрика: учебник для студентов вузов/ Кремер Н.Ш., Путко Б.А.– Электрон. текстовые данные. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015. – 328 с.

4. Орехова С.В. Экономический анализ [Электронный ресурс] : учебное пособие / С.В. Орехова, Е.В. Потапцева. – Электрон. текстовые данные. – Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2016. – 254 с. – 2227-8397. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/951.html>

5. Науменко Т.С. Экономический анализ [Электронный ресурс] : учебное пособие / Т.С. Науменко, Н.А. Чумакова. – Электрон. текстовые данные. – Краснодар: Южный

институт менеджмента, 2016. – 108 с. – 2227-8397. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/9750.html>

б) дополнительная литература:

1. Воскобойников Ю.Е. Построение моделей временных рядов (с примерами в Excel) [Электронный ресурс] : учебное пособие / Ю.Е. Воскобойников. – Электрон. текстовые данные. – Новосибирск: Новосибирский государственный архитектурно-строительный университет (Сибстрин), 2015. – 185 с. – 978-5-7795-0721-9. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/68826.html>

2. Голкина Г.Е. Информационные системы экономического анализа [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Голкина Г.Е., Денисов Д.В.– Электрон. текстовые данные. – М.: Евразийский открытый институт, 2014. – 132 с.– Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10681>. – ЭБС «IPRbooks»

3. Захаров И.В. Теория экономического анализа [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Захаров И.В.– Электрон. текстовые данные. – М.: Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова, 2015. – 176 с.– Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/54667>. – ЭБС «IPRbooks»

4. Дубровский С.А. Методы обработки и анализа экспериментальных данных [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Дубровский С.А., Дудина В.А., Садыева Я.В.– Электрон. текстовые данные. – Липецк: Липецкий государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2015. – 62 с.– Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/55640>. – ЭБС «IPRbooks»

5. Экономический анализ [Электронный ресурс] : практикум / . – Электрон. текстовые данные. – Воронеж: Воронежский государственный архитектурно-строительный университет, ЭБС АСВ, 2015. – 74 с. – 978-5-89040-572-2. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/59140.html>

6. Панягина А.Е. Экономический анализ [Электронный ресурс] : практикум для студентов образовательных программ 38.03.01 Экономика; 38.03.02 Менеджмент / А.Е. Панягина. – Электрон. текстовые данные. – Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2018. – 643 с. – 978-5-4486-0084-5. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69290.html>

в) программное обеспечение и Интернет-ресурсы

Информационно-образовательные ресурсы

–Официальный Web-сайт СахГУ <http://sakhgu.ru/>; sakhgu.pф

–Система управления обучением на базе Moodle <http://cdo.sakhgu.ru/>

–Система независимого компьютерного тестирования в сфере образования <http://i-exam.ru/>

–Сайт научной электронной библиотеки eLIBRARY <http://elibrary.ru>

–Сайт университетской библиотеки ONLINE <http://www.biblioclub.ru/>

–Сайт российской государственной библиотеки <http://www.rsl.ru/>

–Сайт электронно-библиотечной системы IPRbooks <http://www.iprbookshop.ru>

–Сайт информационно правовой системы Консультант Плюс <http://www.consultant.ru>

–Сайт информационной справочной системы Polpred.com [http:// polpred.com/](http://polpred.com/)

–Сайт национальной электронной библиотеки <https://нэб.рф>

–Сайт электронного издательства ЮРАЙТ <https://www.biblio-online.ru>

Информационные технологии и программное обеспечение

– Система технической поддержки и обработки заявок <http://help.sakhgu.net>.

– Программный комплекс «Электронные журналы», используемый для учета и анализа успеваемости обучающихся;

– «Антиплагиат. ВУЗ» Лицензионный договор №194 от 22.03.2018 года;

– Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic OPEN, (бессрочная), (лицензия 60939880);

- Microsoft Office Professional Plus 2010 Russian Academic OPEN, (бессрочная), (лицензия 60939880);
- Kaspersky Anti-Virus (лицензия 2022-000451-54518460), срок пользования с 2017-02-22 по 2019-02-24;
- АБВУФineReader 11 Professional Edition (лицензия AF11-2S1P01-102/AD),
- Справочно-правовая система "Консультант Плюс", сетевая студенческая версия версия «проф». В составе базы: «Судебная практика», «Сахалинский выпуск», «Законопроекты», «деловые бумаги», «международное право», «финансист», «эксперт-приложение», «документы СССР», «комментарии законодательства», «консультации для бюджетных организаций»;
- Справочно-правовая система "Консультант Плюс", сетевая версия «проф». В составе базы: «документы СССР», «бюджетные организации», «строительство», «суды общей юрисдикции», «сахалинский выпуск», «деловые бумаги», «корреспонденция счетов», «международное право», «эксперт-приложение»;
- Программный комплекс «Планы», «Планы СПО» Договор № 4782 от 15.02.2018 года;
- «Диплом-стандарт». Договор № 13651 от 14.05.2013 года (продлонгация от 18.01.2017);
- «Диплом-стандарт». Договор № 12209 от 14.06.2013 года (продлонгация от 18.01.2017)

Автор  к.п.н., доцент Корнева О. С.

Рецензент  к.э.н., доцент Карякина И. Е.

Рассмотрена на заседании кафедры 02 июля 2018 г., протокол № 15.

Утверждена на совете института 10 июля 2018 г., протокол № 10/37.