

18.04.16

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Оренбургский государственный университет»

Кафедра статистики и эконометрики



УТВЕРЖДАЮ

Декан финансово-экономического факультета

(подпись, расшифровка подписи)

*С.В. Памкова*

"25" декабря 2015 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

ДИСЦИПЛИНЫ

«Б.1.В.ДВ.2.2 Статистические методы в финансовом менеджменте»

Уровень высшего образования

БАКАЛАВРИАТ

Направление подготовки

38.03.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки)

Бизнес-аналитика и статистика

(наименование направленности (профиля) образовательной программы)

Тип образовательной программы

Программа академического бакалавриата

Квалификация

Бакалавр

Форма обучения

Очная

Оренбург 2015

**Рабочая программа дисциплины «Б.1.В.ДВ.2.2 Статистические методы в финансовом менеджменте» /сост.**

**Т.В. Леушина - Оренбург: ОГУ, 2015**

Рабочая программа предназначена студентам очной формы обучения по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

© Леушина Т.В., 2015  
© ОГУ, 2015

## Содержание

1 Цели и задачи освоения дисциплины .....	4
2 Место дисциплины в структуре образовательной программы .....	4
3 Требования к результатам обучения по дисциплине .....	7
4 Структура и содержание дисциплины .....	9
4.1 Структура дисциплины .....	9
4.2 Содержание разделов дисциплины .....	9
4.3 Практические занятия (семинары) .....	10
5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины .....	11
5.1 Основная литература .....	11
5.2 Дополнительная литература .....	11
5.3 Периодические издания .....	12
5.4 Интернет-ресурсы .....	13
5.5 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий .....	13
6 Материально-техническое обеспечение дисциплины .....	14
Лист согласования рабочей программы дисциплины .....	
Дополнения и изменения в рабочей программе дисциплины .....	
Приложения:	
Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине .....	
Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины .....	

## 1 Цели и задачи освоения дисциплины

**Цель (цели)** освоения дисциплины: дать слушателям представление об основных показателях и методах статистики в финансовом менеджменте; сформировать навыки работы с бухгалтерской и статистической отчетностью в финансовом менеджменте; познакомить с практическими возможностями статистического анализа и прогнозирования в финансовом менеджменте; приоритетными направлениями исследования в данной области в современных условиях.

### **Задачи:**

1. Знакомство с основными теоретическими положениями статистического анализа в финансовом менеджменте.
2. Знакомство с особенностями формирования информационного обеспечения статистики в финансовом менеджменте.
3. Знакомство с возможностями использования статистических методов в анализе показателей финансового состояния предприятий.
4. Приобретение опыта применения статистических методов в оценке и анализе финансовых рисков предприятия.
5. Приобретение опыта в применении статистико-математических методов в финансовом планировании и прогнозировании.

## 2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к дисциплинам (модулям) по выбору вариативной части блока 1 «Дисциплины (модули)»

Пререквизиты дисциплины: *Б.1.Б.13 Статистика, Б.1.Б.19 Менеджмент, Б.1.Б.22 Финансы*

Требования к входным результатам обучения, необходимым для освоения дисциплины

Предварительные результаты обучения, которые должны быть сформированы у обучающегося до начала изучения дисциплины	Компетенции
<p><b>Знать:</b> Основные философские принципы, законы, категории, а также их содержание и взаимосвязи. Основные философские течения и школы, их проблематику. Специфику философского знания в его связи с наукой.</p> <p><b>Уметь:</b> Провести сравнение различных философских концепций по конкретной проблеме. Выразить и обосновать собственную позицию относительно современных социо- гуманитарных проблем и конкретных философских позиций</p> <p><b>Владеть:</b> Навыками дискуссионного обсуждения вопросов мировоззренческого, методологического и конкретно-научного характера. Навыками философского анализа различных типов мировоззрения, использования различных философских методов для анализа тенденций развития современного общества, а также своей профессиональной деятельности по выбранному направлению подготовки.</p>	ОК-1 способностью использовать основы философских знаний для формирования мировоззренческой позиции
<p><b>Знать:</b> Содержание процессов самоорганизации и самообразования, их особенностей и технологий реализации, исходя из целей совершенствования профессиональной деятельности.</p>	ОК-7 способность к самоорганизации и самообразованию

Предварительные результаты обучения, которые должны быть сформированы у обучающегося до начала изучения дисциплины	Компетенции
<p>Организовывать планирование, анализ, самооценку своей учебно-познавательной деятельности.</p> <p><b>Уметь:</b> Ставить перед собой цели, формулировать задачи и решать их. Самостоятельно строить процесс овладения информацией, отобранной и структурированной для выполнения профессиональной деятельности. Самостоятельно работать с научной и практической литературой по различным проблемам статистических исследований.</p> <p><b>Владеть:</b> Культурой мышления, способностью к восприятию, анализу, обобщению информации, постановке цели и выбору путей ее достижения. Специальной статистической терминологией. Навыками самостоятельного изучения и анализа источников статистической информации.</p>	
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний, необходимых для решения стандартные задачи профессиональной деятельности с применением информационно-коммуникационных технологий</p> <p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для решения стандартных задач профессиональной деятельности с применением информационно-коммуникационных технологий</p> <p><b>Владеть:</b> Владеет обширными статистическими методами для решения стандартных задач профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности</p>	<p>ОПК-1 способностью решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности</p>
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний по сбору, анализу и обработке данных, необходимых для решения профессиональных задач. Имеет системные научные знания в предметной области; конструирует новые знания на межпредметном и метапредметном уровне для решения научно-исследовательских и профессиональных задач.</p> <p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для решения задач сбора, анализа и обработки данных. Решает профессиональные задачи в меняющихся условиях деятельности и корпоративного взаимодействия</p> <p><b>Владеть:</b> Способами познания предметной области, используя информационный поиск. Методологией научного поиска в исследовательской и прикладной деятельности</p>	<p>ОПК-2 способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач</p>
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний, отражающий способность выбирать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы.</p>	<p>ОПК-3 способностью выбирать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной</p>

Предварительные результаты обучения, которые должны быть сформированы у обучающегося до начала изучения дисциплины	Компетенции
<p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для решения задач в выборе инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализе результатов расчетов и обосновании полученных выводов.</p> <p><b>Владеть:</b> Владеет способами познания в выборе инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализе результатов расчетов и обосновании полученных выводов, используя информационный поиск.</p>	задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний, необходимых для поиска организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность.</p> <p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, необходимых для поиска организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность .</p> <p><b>Владеть:</b> Владеет способами познания предметной области, позволяющей находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность.</p>	ОПК-4 способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность
<p><b>Знать:</b> Состав и содержание бухгалтерской (финансовой) отчетности; методику формирования показателей бухгалтерской (финансовой) отчетности современной организации; перечень финансовых показателей формируемых на основе бухгалтерской (финансовой) отчетности.</p> <p><b>Уметь:</b> Ориентироваться в содержании всех форм бухгалтерской (финансовой) отчетности; строить показатели бухгалтерской (финансовой) отчетности; интерпретировать финансовое состояние на основе показателей бухгалтерской (финансовой) отчетности.</p> <p><b>Владеть:</b> Имеет навыки: решения на примерах конкретных хозяйственных ситуаций вопросов оценки, учетной регистрации, накопления и формирования учетной информации финансового характера с целью последующего ее представления и использования в финансовых отчетах; обобщения итогов расчетов показателей бухгалтерской (финансовой) отчетности; оценки финансовой устойчивости и платежеспособности предприятия; прогнозирования вероятности наступления банкротства.</p>	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлении тенденции изменения социально-экономических показателей.</p> <p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях,</p>	ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических

Предварительные результаты обучения, которые должны быть сформированы у обучающегося до начала изучения дисциплины	Компетенции
<p>выявлении тенденции изменения социально-экономических показателей.</p> <p><b>Владеть:</b> Владеет способами познания предметной области, используя информационный поиск.</p>	показателей
<p><b>Знать:</b> Виды носителей информации; основы функционирования систем сбора и обработки статистической информации национальными органами государственной статистики; перечень основных не государственных источников статистической информации; алгоритм поиска статистической информации.</p> <p><b>Уметь:</b> Организовывать работу по сбору, хранению (накоплению) и анализу статистической информации; пользоваться поисковыми системами для «добычи» данных из всемирной сети Интернет; применять системы управления базами данных для хранения (накопления) информации, а также подготовки ее для проведения анализа; обрабатывать статистическую информацию в современных специализированных пакетах программ; представлять результаты статистического исследования в наглядной и доступной форме.</p> <p><b>Владеть:</b> Имеет навыки: сбора информации из различных источников; разработки и проведения выборочных обследований, направленных на сбор информации; формирования базы данных с возможностью дальнейшей обработки информации; применения статистического инструментария к собранной информации посредством пакетов программ; подготовки аналитических отчетов на заданную тему.</p>	ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Постреквизиты дисциплины: *Отсутствуют*

### 3 Требования к результатам обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих результатов обучения

Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Формируемые компетенции
<p><b>Знать:</b> Имеет полный объем знаний, отражающий способность собирать и анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p><b>Уметь:</b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для решения задач сбора и анализа исходных данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p> <p><b>Владеть:</b> Владеет способами познания в сборе и анализе исходных данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</p>	ПК-1 способность собирать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Формируемые компетенции
<p><b><u>Знать:</u></b> Как на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты</p> <p><b><u>Уметь:</u></b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для построения стандартных теоретических и эконометрических моделей, анализа и содержательной интерпретации полученных результатов</p> <p><b><u>Владеть:</u></b> Способами познания для построения стандартных теоретических и эконометрических моделей, анализа и содержательной интерпретации полученных результатов, используя информационный поиск</p>	<p>ПК-4 способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты</p>
<p><b><u>Знать:</u></b> Имеет полный объем знаний анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлении тенденции изменения социально-экономических показателей.</p> <p><b><u>Уметь:</u></b> Демонстрирует умения выбора средств и методов, достаточных для анализа и интерпретации данных отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлении тенденции изменения социально-экономических показателей.</p> <p><b><u>Владеть:</u></b> Владеет способами познания предметной области, используя информационный поиск.</p>	<p>ПК-6 способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей</p>
<p><b><u>Знать:</u></b> Виды носителей информации; основы функционирования систем сбора и обработки статистической информации национальными органами государственной статистики; перечень основных не государственных источников статистической информации; алгоритм поиска статистической информации.</p> <p><b><u>Уметь:</u></b> Организовывать работу по сбору, хранению (накоплению) и анализу статистической информации; пользоваться поисковыми системами для «добычи» данных из всемирной сети Интернет; применять системы управления базами данных для хранения (накопления) информации, а также подготовки ее для проведения анализа; обрабатывать статистическую информацию в современных специализированных пакетах программ; представлять результаты статистического исследования в наглядной и доступной форме.</p> <p><b><u>Владеть:</u></b> Имеет навыки: сбора информации из различных источников; разработки и проведения выборочных обследований, направленных на сбор информации; формирования базы данных с возможностью дальнейшей обработки информации; применения статистического инструментария к собранной информации посредством пакетов программ; подготовки аналитических отчетов на заданную тему.</p>	<p>ПК-7 способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет</p>



## 4 Структура и содержание дисциплины

### 4.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единиц (144 академических часов).

Вид работы	Трудоемкость, академических часов	
	7 семестр	всего
<b>Общая трудоёмкость</b>	<b>144</b>	<b>144</b>
<b>Контактная работа:</b>	<b>34,25</b>	<b>34,25</b>
Лекции (Л)	18	18
Практические занятия (ПЗ)	16	16
Промежуточная аттестация (зачет, экзамен)	0,25	0,25
<b>Самостоятельная работа:</b>	<b>109,75</b>	<b>109,75</b>
- самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий);	36	36
- подготовка к практическим занятиям;	41,75	41,75
- подготовка к рубежному контролю.	32	32
<b>Вид итогового контроля (зачет, экзамен, дифференцированный зачет)</b>	<b>диф. зач.</b>	

Разделы дисциплины, изучаемые в 7 семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		всего	аудиторная работа			внеауд. работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	Сущность, организация, основные категории финансового менеджмента	13	2	1	10	
2	Задачи, методы, информационная база статистики в финансовом менеджменте	13	2	1	10	
3	Методы статистико-экономического анализа финансового состояния предприятия	33	4	4	25	
4	Статистические методы оценки и анализа финансовых рисков	33	4	4	25	
5	Статистико-математические методы финансового прогнозирования	52	6	6	40	
	Итого:	144	18	16	110	
	Всего:	144	18	16	110	

### 4.2 Содержание разделов дисциплины

**Раздел 1. Сущность, организация, основные категории финансового менеджмента.**  
Понятие финансового менеджмента, цели, задачи. Функции финансового менеджмента. Фундаментальные концепции, на которых базируется финансовый менеджмент. Принципы организации финансового менеджмента на предприятии. Система финансового менеджмента, субъект и объект процесса управления. Внешняя экономическая среда фирмы.

**Раздел 2. Задачи, методы, информационная база статистики в финансовом менеджменте.**  
Задачи статистики в оценке и анализе эффективности управления финансовыми ресурсами и финансовыми отношениями экономического объекта. Методы статистики в финансовом менеджменте: табличный, графический, обобщающих показателей, вариации, структуры, динамики,

индексный, корреляционный, регрессионный, факторный, дисперсионный анализ. Информационная база статистики в финансовом менеджменте: формы бухгалтерской и статистической отчетности.

### **Раздел 3. Методы статистико-экономического анализа финансового состояния предприятия.**

Сущность финансового анализа, объект и субъект финансового анализа, исходная информация. Классификация методов финансового анализа. Сущность экспресс-анализа финансового состояния предприятия, этапы осуществления, применяемые статистические методы. Цель и этапы углубленного анализа финансового состояния предприятия. Абсолютные, относительные и средние величины, используемые в углубленном анализе финансового состояния предприятия. Методы расчета общих показателей; показателей платежеспособности и финансовой устойчивости; показателей эффективности использования оборотного капитала (деловой активности), доходности и финансового результата; показателей эффективности использования внеоборотного капитала и инвестиционной активности организации; показателей исполнения обязательств перед бюджетом и государственными внебюджетными фондами.

### **Раздел 4. Статистические методы оценки и анализа финансовых рисков.**

Понятие, виды, содержание финансовых рисков. Классификация методов оценки финансовых рисков. Экспертный и аналоговый методы оценки уровня финансового риска. Статистические методы оценки уровня финансового риска: расчет средних ожидаемых значений; расчет показателей вариации – дисперсии, среднего квадратического отклонения, коэффициента вариации. Бета-коэффициент. Уровень премии за риск. Сумма премии за риск. Общий уровень доходности финансовых операций с учетом фактора риска. Уровень избыточной доходности всего портфеля ценных бумаг на единицу его риска. Система критериев оценки неплатежеспособности предприятия. Статистические многофакторные (скоринговые) модели диагностики финансового кризиса и оценки потенциального банкротства.

### **Раздел 5. Статистико-математические методы финансового прогнозирования.**

Актуальность и основные понятия финансового планирования и прогнозирования. Классификация методов финансового прогнозирования. Специфика статистических методов в финансовом прогнозировании. Индексный метод. Построение эконометрических моделей связи и изменения во времени. Оценка значимости и качества полученных моделей. Экстраполяция финансовых показателей на основе оценки их тенденций: расчет показателей динамики; метод скользящей средней; метод аналитического выравнивания; авторегрессионные эконометрические модели; адаптивные методы анализа и прогнозирования (экспоненциальное сглаживание), нейросетевые модели.

#### **4.3 Практические занятия (семинары)**

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	1	Сущность, организация, основные категории финансового менеджмента	1
1	2	Задачи, методы, информационная база статистики в финансовом менеджменте	1
2,3	3	Методы статистико-экономического анализа финансового состояния предприятия	4
4,5	4	Статистические методы оценки и анализа финансовых рисков	4
6,7,8	5	Статистико-математические методы финансового прогнозирования	6
		Итого:	16

## 5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Основная литература

1. Эконометрика [Электронный ресурс]: учеб. для вузов / под ред. В. Н. Афанасьева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т" ; [В. Н. Афанасьев и др.]. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург: ОГУ, 2012. - Adobe Acrobat Reader 5.0.
2. Афанасьев, В.Н. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебник / В.Н. Афанасьев, М.М. Юзбашев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Финансы и статистика, 2012. - 320 с. - ISBN 978-5-279-03400-0; [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=215316>.
3. Афанасьев, В.Н. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебник / В.Н. Афанасьев, М.М. Юзбашев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Финансы и статистика, 2012. - 320 с. - ISBN 978-5-279-03400-0.

### 5.2 Дополнительная литература

1. Лукасевич, И. Я. Финансовый менеджмент: учеб. для вузов / И. Я. Лукасевич. - Москва: Эксмо, 2009. - 467 с.: рис. - (Высшее экономическое образование). - Библиогр.: с. 761-765. - ISBN 978-5-699-22331-2.
2. Белолипецкий, В. Г. Финансовый менеджмент: учеб. пособие / В. Г. Белолипецкий. - Москва: КноРус, 2008. - 448 с. - Прил.: с. 428-444. - Библиогр.: с. 445-447. - ISBN 978-5-85971-982-2.
3. Максименко, О. В. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: курс лекций / О. В. Максименко; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. агентство по образованию, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т", Колледж электроники и бизнеса. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург: ГОУ ОГУ, 2007. - Adobe Acrobat Reader 5.0.
4. Скобелева, Е. В. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: электронный курс лекций / Е. В. Скобелева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т", Каф. корпоратив. финансов и оценки собственности. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: 3,05 МБ). - Оренбург: ОГУ, 2013. - Архиватор 7-Zip.
5. Прибыткова, Г. К. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: дидакт. материал "Финансовый менеджмент в схемах, рисунках, расчетах" / Г. К. Прибыткова; М-во образования Рос. Федерации, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т"; Колледж электроники и бизнеса, Каф. экон.-правовых дисциплин. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург: ГОУ ОГУ, 2003. - Adobe Acrobat Reader 5.0.
6. Эконометрика для бакалавров (учебник). - Оренбург: ООО ИПК «Университет», 2014. - 434 с. - ISBN 978-5-4417-0467-0.
7. Практикум по финансовой статистике: учеб. пособие / Т.В. Тимофеева, А.А. Снатенков. - Москва: Финансы и статистика; ИНФРА-М, 2009. - 320 с.: ил. - ISBN 978-5-279-03359-1 (Финансы и статистика), ISBN 978-5-16-003662-5 (ИНФРА-М).
8. Афанасьев, В. Н. Статистические методы прогнозирования в экономике: учеб.-метод. пособие / В. Н. Афанасьев, Т. В. Лебедева. - М.: Финансы и статистика, 2009. - 180 с. - Библиогр.: с. 179. - ISBN 978-5-279-03401-7.
9. Афанасьев, В. Н. Моделирование и прогнозирование временных рядов: учеб.-метод. пособие / В. Н. Афанасьев, Т. В. Лебедева. - Москва: Финансы и статистика, 2009. - 292 с. : ил. - Прил.: с. 251-286. - Библиогр.: с. 287. - ISBN 978-5-279-03402-4.
10. Афанасьев, В.Н. Статистическое исследование банковского кредитования / В.Н. Афанасьев, Т.В. Леушина, Т.В. Лебедева; Оренбургский гос. ун-т. - Оренбург: ОГУ, 2011. - 300 с., ил. - ISBN 978-5-7410-1136-2.
11. Балтина, А. М. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс] : учеб.-практ. пособие / А. М. Балтина, Н. М. Крюкова; М-во образования и науки Рос. Федерации, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т", Центр дистанц. образования. - Электрон. текстовые дан. - Оренбург : ГОУ ОГУ, 2001. - Загл. с экрана.

12. Пекарская, Н. Э. Финансово-банковская статистика: учеб.-практ. пособие / Н. Э. Пекарская, А. Э. Ярмолинская; М-во образования республики Беларусь, УО "Белорус. гос. экон. ун-т". - Минск: БГЭУ, 2006. - 73 с. - (Система дистанционного обучения). - Библиогр.: с. 74. - ISBN 985-484-270-3.
13. Финансовая статистика: учеб. пособие / Т.В. Тимофеева, А.А. Снатенков, Е.Р. Мендыбаева; под ред. Т.В. Тимофеевой. – Москва: Финансы и статистика, 2006. – 480 с. – ISBN 5,279-03135-6.
14. Садовникова, Н.А. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебно-методический комплекс / Н.А. Садовникова, Р.А. Шмойлова. - Москва: Евразийский открытый институт, 2011. - Вып. 5. - 259 с. - ISBN 978-5-374-00199-0; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=90649>.
15. Лукашин, Ю. П. Адаптивные методы краткосрочного прогнозирования временных рядов: учеб. пособие для вузов / Ю. П. Лукашин. - Москва: Финансы и статистика, 2003. - 416 с.: ил. - ISBN 5-279-02740-5.
16. Боровиков, В. П. Прогнозирование в системе STATISTICA в среде Windows : основы теории и интенсивная практика на компьютере: учеб. пособие для вузов / В. П. Боровиков, Г. И. Ивченко. - Москва: Финансы и статистика, 2000. - 384 с. - Прил.: с. 361-376. - Предм. указ.: с. 377-378. - ISBN 5-279-01980-1.
17. Валеев, Н.Н. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебное пособие / Н.Н. Валеев, А.В. Аксянова, Г.А. Гадельшина; Федеральное агентство по образованию, Государственное образовательное учреждение высшего профессионального образования "Казанский государственный технологический университет". - Казань: КГТУ, 2010. - 160 с.: ил, табл. - Библ. в кн. - ISBN 978-5-7882-0862-6; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=270575> (12.11.2015).
18. Дуброва, Т. А. Статистические методы прогнозирования: учебное пособие / Т. А. Дуброва. - Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2003. - 206 с. - Прил.: с. 192-205. - ISBN 5-238-00497-4.
19. Минашкин, В.Г. Бизнес-статистика и прогнозирование: учебно-практическое пособие / В.Г. Минашкин, Н.А. Садовникова, Р.А. Шмойлова. - Москва: Евразийский открытый институт, 2010. - 255 с. - ISBN 978-5-374-00379-6; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=90810> (12.11.2015).
20. Лебедева, Т. В. Анализ временных рядов и прогнозирование [Электронный ресурс]: метод.указания / Т. В. Лебедева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. агентство по образованию, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург.гос. ун-т", Каф. статистики и эконометрики. - Электрон.текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург :ГОУОГУ, 2009. - AdobeAcrobatReader 5.0
21. Моделирование и прогнозирование на основе моделей Бокса-Дженкинса [Электронный ресурс]: метод.указания к лаб. практикуму и самостоят. работе студентов / А. Г. Реннер [и др.]; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. агентство по образованию, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург.гос. ун-т", Каф. мат. методов и моделей в экономике. - Электрон.текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург :ГОУОГУ, 2008. -AdobeAcrobatReader 5.0.
22. Кузнецова, В. Е. Статистическое моделирование временных рядов с использованием метода классической сезонной декомпозиции (метод Census 1) ПППStatistika 5.5 [Текст]: метод.указания по курсу "Анализ временных рядов и прогнозирование" / В. Е. Кузнецова, В. А. Сивелькин; М-во образования Рос. Федерации, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург.гос. ун-т", Каф. статистики. - Оренбург :ОГУ, 2002. - 33 с
23. Туктамышева, Л. М. Моделирование и прогнозирование на основе методов экспоненциального сглаживания [Электронный ресурс]: метод.указания к лаб. практикуму и самостоят. работе студентов / Л. М. Туктамышева, Е. Н. Седова, О. И. Бантикова; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. агентство по образованию, Гос. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург.гос. ун-т", Каф. мат. методов и моделей в экономике. - Электрон.текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург :ГОУОГУ, 2008. -AdobeAcrobatReader 5.0

### 5.3 Периодические издания

1. Вопросы статистики: журнал. - М.: ИИЦ «Статистика России».

2. Вопросы экономики: журнал. – М.: НП «Редакция журнала «Вопросы экономики».
3. Экономический журнал ВШЭ: журнал. – М.: Издательский дом Государственного Университета - Высшей Школы Экономики.
4. Российский экономический журнал: журнал. – М.: Изд-во «Финансы и статистика».
5. Банковские услуги: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
6. Финансы и кредит: журнал. - М.: ООО "Издательский дом Финансы и кредит".
7. Финансы и бизнес: журнал. – М.: Изд-во «Перспектив».
8. Экономический анализ: теория и практика: журнал. – М.: Издательский дом «Финансы и кредит».
9. Бухгалтерия и банки: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
10. Рынок ценных бумаг: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
11. Проблемы прогнозирования: журнал. – М.: Агенство "Роспечать".
12. Российская экономика: прогнозы и тенденции: журнал. – М.: Агенство "Роспечать".
13. Эксперт: журнал. – М.: Агенство "Роспечать".

#### 5.4 Интернет-ресурсы

1. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики <http://www.gks.ru>.
2. Официальный сайт Территориального органа Федеральной службы государственной статистики по Оренбургской области <http://www.orenstat.ru>.
3. Официальный сайт «Высшей школы экономики» <http://www.hse.ru>.
4. Официальный сайт Федеральной службы по финансовым рынкам <http://www.fcsm.ru/>.
5. Официальный сайт информационного агентства Финмаркет <http://www.finmarket.ru/>.
6. Официальный сайт журнала «Экономическое обозрение» <http://www.review.uz/ru>.
7. Официальный сайт Международной компании «Прогноз» <http://www.prognoz.ru>.
8. Официальный сайт Российского отделения Академии прогнозирования <http://www.maib.ru/prognostication/>.
9. Официальный сайт журнала «Эксперт» <http://expert.ru>.
10. Официальный сайт инвестиционного холдинга «ФИНАМ» <http://www.finam.ru>.
11. Официальный сайт «Бизнес Клуб Онлайн» <http://biznesklubonline.com>.

#### 5.5 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий

ОГУ обеспечивает доступ к современным профессиональным базам данных, информационным справочным и поисковым системам «Консультант Плюс», «Гарант», «Экономика. Социология. Менеджмент. Образовательный портал», «Российский ресурсный центр учебных кейсов».

С целью улучшения качества самостоятельной работы студентов и внедрения передовых методов в обучении, на кафедре статистики и эконометрики запущен информационный портал, на котором размещены необходимые для учебного процесса электронные информационные ресурсы.

В настоящее время на информационном портале кафедры располагается следующая информация:

- общая информация о кафедре;
- учебно-методические комплексы по всем дисциплинам кафедры, в т.ч. учебно-методические материалы (методические указания и пособия по дисциплинам);
- учебная и научная литература ППС кафедры и внешних авторов;
- статистические сборники Территориального органа государственной статистики по Оренбургской области;
- материалы по выпускным квалификационным работам и всем видам практик;
- форум для студентов и преподавателей.

Информационный портал реализован на базе сервера с операционной системой Microsoft Windows Server 2003 R2 Enterprise Editions и бесплатного дополнения Microsoft SharePoint Service

2.0 (WSS), реализующего полнофункциональную веб-платформу с поддержкой следующих основных возможностей:

- система управления контентом;
- средства для совместной работы;
- общие календари и списки контактов;
- форумы для обсуждений;
- блоги и вики-разделы;
- управление документами за счет создания центрального репозитория для общедоступных документов;
- взаимодействие на основе веб-технологий, совместное редактирование общедоступных документов, а также рабочие пространства для документов;
- браузерное управление и администрирование;
- настраиваемые веб-страницы при помощи специальных панелей настройки, веб-инструменты, а также механизмы навигации.

## **6 Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Кафедра статистики и эконометрики оснащена компьютерным классом, подключенным к локальной сети ОГУ и сети Интернет, предназначенным для проведения аудиторных занятий студентов по дисциплинам кафедры и индивидуальных занятий студентов, аспирантов и преподавателей для подготовки курсовых, дипломных проектов, диссертаций, научных статей, подготовки к конкурсам, олимпиадам и т.д. Класс оснащен всем необходимым оборудованием, в нем установлено 14 компьютеров и LSD проектор мультимедиа EPSON EMP-X3.

### ***К рабочей программе прилагаются:***

- Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине;
- Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

**ЛИСТ**  
**согласования рабочей программы**

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика  
код и наименование

Профиль: Бизнес-аналитика и статистика

Дисциплина: Б.1.В.ДВ.2.2 Статистические методы в финансовом менеджменте

Форма обучения: \_\_\_\_\_  
очная  
(очная, очно-заочная, заочная)

Год набора 2015

РЕКОМЕНДОВАНА заседанием кафедры  
Кафедра статистики и эконометрики  
наименование кафедры

протокол № 13 от "18" декабря 2015г.

Ответственный исполнитель, заведующий кафедрой  
Кафедра статистики и эконометрики  
наименование кафедры            Афанасьев В.Н.  
подпись      расшифровка подписи


Исполнители:  
Доцент            Леушина Т.В.  
должность      подпись      расшифровка подписи

\_\_\_\_\_      \_\_\_\_\_      \_\_\_\_\_  
должность      подпись      расшифровка подписи

**СОГЛАСОВАНО:**

Председатель методической комиссии по направлению подготовки  
38.03.01 Экономика            Панкова С.В.  
код наименование      личная подпись      расшифровка подписи

Заведующий отделом комплектования научной библиотеки  
      Истомина Т.В.  
личная подпись      расшифровка подписи

Начальник отдела информационных образовательных технологий ЦИТ  
      Дырдина Е.В.  
личная подпись      расшифровка подписи

**Дополнения и изменения в рабочей программе дисциплины  
«Б.1.В.ДВ.2.2 Статистические методы в финансовом менеджменте» для студентов очной  
формы обучения по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль Бизнес-  
аналитика и статистика на 2016 год набора**

Внесенные изменения на 2016 год набора



УТВЕРЖДАЮ

И.о. декана финансово-экономического факультета

В.А. Волохина

с 26 февраля 2016 г.

В рабочую программу вносятся следующие изменения:

**5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

**5.2 Дополнительная литература**

Список дополнительной литературы дополнен следующими источниками:

1 Экономическая статистика [Электронный ресурс]: учебник / под ред. Ю.Н. Иванова. Н., 5-е изд., перераб. и доп. - Москва: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 576 с. – ISBN 978-5-16-010399-0. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=486863>. – Электронно-библиотечная система ZNANIUM.COM.

2 Методологический комментарий к Обзору центрального банка, Обзору кредитных организаций, Обзору банковской системы, Обзору других финансовых организаций (по данным страховых организаций и негосударственных пенсионных фондов), Обзору финансового сектора (по данным организаций банковской системы, страховых организаций и негосударственных пенсионных фондов) [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [http://www.cbr.ru/statistics/credit\\_statistics/Comments.pdf](http://www.cbr.ru/statistics/credit_statistics/Comments.pdf)

**5.4 Интернет-ресурсы**

Список интернет-ресурсов дополнен следующими источниками:

1. Денежно-кредитная и финансовая статистика. – Москва: Банк России. – <http://www.cbr.ru/statistics>.

2. Центральный Банк России - <http://www.cbr.ru>.

3. Министерство финансов Российской Федерации - <http://www.minfin.ru>.

**5.5. Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий**

1 ГАРАНТ Платформа F1 [Электронный ресурс]: справочно-правовая система. / Разработчик ООО НПП «ГАРАНТ-Сервис», 119992, Москва, Воробьевы горы, МГУ, 2016. - Режим доступа в сети ОГУ для установки системы: \\fileserver1\GarantClient\garant.exe



2 КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: электронное периодическое издание справочная правовая система. / Разработчик ЗАО «Консультант Плюс», 2016. – Режим доступа к системе в сети ОГУ для установки системы: \\fileserv1\CONSULT\cons.exe

3 Специальная подборка правовых документов и учебных материалов [Электронный ресурс]: Программа информационной поддержки российской науки и образования 'Консультант-Плюс: Высшая школа': учеб. пособие для студентов юрид., финанс. и экон. специальностей / гл. ген. директор компании Д.Б. Новиков; Вып. 25; К весеннему семестру 2015-2016 учебного года. - [Б. м.] : КонсультантПлюс, 2015-2016. - 1 электрон. диск. - (Электронная библиотека студента).

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры статистики и эконометрики протокол № 18 от "24" 02 2016г.

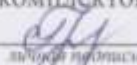
Заведующий кафедрой статистики и эконометрики



В.Н. Афанасьев

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий отделом комплектования научной библиотеки



*личная подпись*

Н.Н. Грицай

*расшифровка подписи*

Уполномоченный по качеству финансово-экономического факультета



*личная подпись*

Н.А. Тычина

*расшифровка подписи*

**Дополнения и изменения в рабочей программе дисциплины  
«Б.1.В.ДВ.2.2 Статистические методы в финансовом менеджменте» для студентов  
очной формы обучения по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль  
Бизнес-аналитика и статистика на 2017 год набора**

Внесенные изменения на 2017 год набора

УТВЕРЖДАЮ  
Декаан финансово-экономического  
факультета  
  
Е.В. Смирнова  
« 28 » февраля 2017 г.

В рабочую программу вносятся следующие изменения:

### **5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

#### **5.2 Дополнительная литература**

Список дополнительной литературы дополнен следующими источниками:

1 Афанасьев, В. Н., Основы бизнес-статистики [Текст] : учебное пособие для обучающихся по образовательной программе высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика / В. Н. Афанасьев, Н. С. Еремеева, Т. В. Лебедева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. образования "Оренбург. гос. ун-т". - Оренбург : ОГУ, 2017. - 244 с. : ил.; 15,31 печ. л. - Библиогр.: с. 242-243. - ISBN 978-5-4417-0681-0.

2 Яковлева, И. В., Организация финансовой работы на предприятии [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов, обучающихся по программам высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика / И. В. Яковлева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. образования "Оренбург. гос. ун-т". - Электрон. текстовые дан. (1 файл: 14101 Кб). - Оренбург : ОГУ, 2016. - Adobe Acrobat Reader 6.0 - ISBN 978-5-7410-1469-1.

#### **5.4 Интернет-ресурсы**

Список интернет-ресурсов дополнен следующими источниками:

- Журнал «Финансовый менеджмент» - Режим доступа: <http://www.dis.ru/fin/>.
- Основы финансового менеджмента. Курс лекций - Режим доступа: <http://www.cfin.ru/finanalysis/lytnev/index.shtml>.
- Мультистат. Многофункциональный статистический портал - Режим доступа: <http://www.multistat.ru/>.
- Статистика онлайн - Режим доступа: <http://guide.aonb.ru/stat.html>.
- Статистическая база данных по российской экономике ГУ-ВШЭ – Режим доступа: <http://stat.hse.ru/>.
- Основные экономические показатели - Режим доступа: <http://www.eeg.ru/pages/22>.

## 5.5. Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий

Программное обеспечение для статистических исследований:

1. Stata / IC 11.0
2. STATISTICA Advanced for Windows v.7 En, состоящая из трех блоков STATISTICA Base + Multivariate; Exploratory Techiques + Advanced; Linear / Non-Linear Models +Power Analysis
3. STATISTICA Automated Neural Networks Code Generator v.9 English. Однопользовательская версия
4. STATISTICA Automated Neural Networks for Windows v.9 English. Сетевая версия
5. ГАРАНТ Платформа F1 [Электронный ресурс]: справочно-правовая система. / Разработчик ООО НПП «ГАРАНТ-Сервис», 119992, Москва, Воробьевы горы, МГУ, 2016. - Режим доступа в сети ОГУ для установки системы: \\fileserv1\GarantClient\garant.exe
6. Консультант Плюс [Электронный ресурс]: электронное периодическое издание справочная правовая система. / Разработчик ЗАО «Консультант Плюс», 2016. – Режим доступа к системе в сети ОГУ для установки системы: \\fileserv1\CONSULT\cons.exe

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры статистики и эконометрики  
протокол № 22 от "20" февраля 2017 г.

Заведующий кафедрой статистики и эконометрики



В.Н. Афанасьев

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий отделом комплектования научной библиотеки

  
*личная подпись*

Н.Н. Грицай

*расшифровка подписи*

Уполномоченный по качеству финансово-экономического факультета

  
*личная подпись*

Н.А. Тучинина

*расшифровка подписи*