

Статистика финансов

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики минерально-сырьевого комплекса**

Учебный план b010305_25_BA25.plx
Направление подготовки 01.03.05 Статистика

Квалификация **Бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108
в том числе:
аудиторные занятия 48,25
самостоятельная работа 59,75

Виды контроля в семестрах:
зачеты 7

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	7 (4.1)		Итого	
Неделя	16 4/6			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	16	16	16	16
Практические	32	32	32	32
Иные виды контактной работы	0,25	0,25	0,25	0,25
В том числе инт.	4	4	4	4
Итого ауд.	48,25	48,25	48,25	48,25
Контактная работа	48,25	48,25	48,25	48,25
Сам. работа	59,75	59,75	59,75	59,75
Итого	108	108	108	108

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1.1	Целью изучения учебной дисциплины «Статистика финансов» является формирование у обучающихся твердых теоретических знаний и практических навыков по использованию методов финансовых вычислений при анализе потоков платежей, эффективности инвестиционных проектов, расчете процентов и доходности финансово-кредитных операций в современных экономических условиях.
-----	---

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП:		ФТД
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Информационные технологии	
2.1.2	Системы искусственного интеллекта	
2.1.3	Статистика как наука и профессиональная деятельность	
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Машинное обучение (Machine Learning)	
2.2.2	Информационно-аналитическое обеспечение принятия управленческих решений	
2.2.3	Банковская и биржевая статистика	
2.2.4	Статистика полезных ископаемых и геологоразведочных работ	
2.2.5	Геостатистика	
2.2.6	Статистика качества	

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**ПК-7: Способен формировать возможные решения на основе разработанных для них целевых показателей****Знать:**

Уровень 1	Референтные модели оценки систем управления
Уровень 2	Методы структурной декомпозиции процессов
Уровень 3	Принципы и методы трансляции целей организации в показатели процессов

Уметь:

Уровень 1	Анализировать плановые и отчетные показатели системы процессного управления организации
Уровень 2	Производить сравнительный анализ показателей систем процессного управления организаций
Уровень 3	Анализировать имеющиеся ресурсы и составлять перспективные планы развития организаций

Владеть:

Уровень 1	Навыками сбора информации о результатах работы действующей системы процессного управления организации
Уровень 2	Навыками оценки текущих показателей действующей системы процессного управления по принятой модели и определения целевых показателей системы процессного управления организации и ее компонентов
Уровень 3	Навыками оценки соответствия экономической и функциональной эффективности системы процессного управления организации целям системы управления организацией и требованиям к ней

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	основные категории аппарата, теоретические положения и методы системного анализа и принятия решений;
3.1.2	основы сбора, обработки информации для научного исследования;
3.1.3	принципы разработки инфраструктурных решений
3.2	Уметь:
3.2.1	реализовывать системный подход для анализа задач из областей профессиональной деятельности;
3.2.2	формировать рекомендации для принятия эффективных решений на основе системного подхода для решения поставленной задачи в сфере профессиональной деятельности;
3.2.3	применять интеллектуальные технологии анализа данных в информационно-аналитической деятельности
3.3	Владеть:
3.3.1	навыками адаптации теоретических моделей и методов системного анализа и принятия решений для решения задач из областей профессиональной деятельности;
3.3.2	навыками составления прогнозов при решении поставленной задачи в области профессиональной деятельности;
3.3.3	навыками принятия решений на основе интеллектуального анализа данных современных информационных систем управления

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)							
Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетен-ции	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. Предмет, метод и задачи финансовой статистики. Базовые понятия и терминология						
1.1	Понятие, задачи, методологический инструментарий финансовой статистики; система показателей, источники информации. /Лек/	7	2	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
1.2	Понятие и виды ценных бумаг. Сводные биржевые индексы. Кредитные рейтинги /Пр/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	4	
1.3	Понятие, структура и функции финансового рынка; задачи его статистического изучения. /Ср/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
	Раздел 2. Статистика государственного бюджета и налоговая статистика						
2.1	Элементы инфраструктуры государственных финансов. Задачи статистики государственных бюджетов, источники информации. /Лек/	7	2	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
2.2	Основные показатели государственного бюджета: доходы, официальные трансферты, расходы, чистое кредитование, профицит, дефицит. Функциональная, экономическая, ведомственная классификации. Формы финансирования госбюджета. /Пр/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
2.3	Абсолютные и относительные показатели статистики налоговой сферы. Аддитивные и мультипликативные модели динамики налоговых доходов /Ср/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
	Раздел 3. Статистика денежного спроса, оборота и обращения						
3.1	Задачи денежно-кредитной статистики. Виды денег, денежные агрегаты, миграция денег; держатели денежных инструментов; ликвидность финансовых активов. /Лек/	7	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	

3.2	Кредит как форма движения ссудного капитала, классификация ссуд, источники ссудного капитала. Принципы кредитования. Относительные показатели кредитоспособности. Задачи и система абсолютных и относительных показателей денежного обращения. Денежный оборот, денежный мультипликатор, уровень монетаризации экономики /Пр/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
3.3	Уравнение обмена. Номинальная и реальная денежная масса. Покупательная способность денег, индекс покупательной способности рубля. Скорость обращения денег, продолжительность одного оборота /Ср/	7	15	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
Раздел 4. Статистика использования кредитных вложений							
4.1	Понятие кредитных вложений, виды банковских ссуд. Показатели объема кредитных вложений. Индексные системы оборота кредита по погашению, среднего остатка кредита, средней длительности пользования кредитом. /Лек/	7	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
4.2	Уровень оборачиваемости кредита, коэффициент рефинансирования, коэффициент эффективности использования привлеченных средств. /Пр/	7	5	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
4.3	Виды процента. Кредитная активность банка. /Ср/	7	15	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
Раздел 5. Статистическое изучение экономической эффективности инвестиций							
5.1	Виды и субъекты инвестиций. Этапы инвестиционного процесса. Методы оценки эффективности инвестиций. /Лек/	7	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
5.2	Индексы доходности затрат, дисконтированных инвестиций. Внутренняя норма доходности; номинальная, реальная и эффективная ставка процента. /Пр/	7	6	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
5.3	Срок окупаемости, момент окупаемости, дисконтированный срок окупаемости. Оценка безубыточности инвестиционного процесса. Капитал риска /Ср/	7	14,1	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	

	Раздел 6. Статистическая оценка инфляционных процессов и финансовых операций в СНС. Индексы цен основных агрегатов национального счетоводства						
6.1	Понятие инфляции; показатели, характеризующие уровень инфляции. Принципы и методы дефлятирования основных макроэкономических показателей. /Лек/	7	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
6.2	Виды экономических операций с финансовыми инструментами. /Пр/	7	6	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
6.3	Показатели финансовых операций, отражаемые в СНС; структура финансового счета, направления его анализа /Ср/	7	5,65	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	
	Раздел 7. Итоговая аттестация						
7.1	Прием зачета /ИВКР/	7	0,25	ПК-7	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4 Э5 Э6 Э7 Э8 Э9 Э10	0	

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

5.1. Контрольные вопросы и задания

Контрольные вопросы для подготовки к промежуточной аттестации:

1. Предмет, задачи и методы статистики финансов.
 2. Система показателей статистики финансов.
 3. Основные категории и понятия статистики финансов (финансовые ресурсы, денежные потоки, ликвидность и др.).
 4. Источники данных и организация статистического наблюдения в финансовой сфере.
 5. Статистика государственного бюджета: доходы, расходы, дефицит/профицит.
 6. Показатели исполнения бюджета и их анализ.
 7. Статистика налогов и налоговых поступлений.
 8. Статистика государственного долга: внутреннего и внешнего.
 9. Статистика денежного обращения: денежная масса, денежные агрегаты.
 10. Инфляция и её статистическое измерение (индексы потребительских цен, дефляторы).
 11. Статистика кредита: объёмы кредитования, процентные ставки, просроченная задолженность.
 12. Статистика банковской системы: показатели деятельности банков.
 13. Статистика финансовых рынков: фондовый рынок, валютный рынок.
 14. Статистика инвестиций: прямые, портфельные, иностранные инвестиции.
 15. Статистика страхования: объёмы страховых премий, выплат, страховые резервы.
 16. Финансы предприятий: показатели прибыли, рентабельности, ликвидности.
 17. Статистика финансов домашних хозяйств: доходы, расходы, сбережения.
 18. Международная статистика финансов: платёжный баланс, международные резервы.
 19. Финансовые индексы и их расчёт (индексы Доу-Джонса, S&P 500 и др.).
 20. Корреляционно-регрессионный анализ в статистике финансов.
 21. Прогнозирование финансовых показателей: методы и модели.
 22. Риски в финансовой статистике: методы оценки и управления.
 23. Система национальных счетов (СНС) и её связь со статистикой финансов.
 24. Финансовая отчётность и её статистический анализ.
 25. Современные информационные технологии в статистике финансов.
- Задания для текущего контроля представлены в Приложении 1.

5.2. Темы письменных работ

К письменным работам по дисциплине «Статистика финансов» относятся рефераты.

Примерные темы рефератов:

1. Анализ структуры доходов и расходов государственного бюджета
2. Дефицит и профицит бюджета: методы оценки и регулирования
3. Статистический анализ налоговой нагрузки в экономике
4. Государственный долг: динамика, структура и управление
5. Бюджетный федерализм: статистика межбюджетных отношений
6. Денежная масса и её влияние на экономику
7. Инфляция: методы измерения и факторы влияния
8. Статистика кредитования: тенденции и риски
9. Процентные ставки и их роль в финансовой системе
10. Банковская система: анализ ключевых показателей
11. Фондовый рынок: индексы и динамика цен
12. Валютный рынок: статистика курсовых колебаний
13. Прямые и портфельные инвестиции: сравнительный анализ
14. Иностранные инвестиции и их влияние на экономику
15. Криптовалюты: статистика и тенденции развития
16. Анализ финансовой устойчивости предприятия
17. Рентабельность и ликвидность: статистические методы оценки
18. Корпоративные облигации: рынок и доходность
19. Страховой рынок: объёмы премий и выплат
20. Финансовые риски: методы оценки и управления
21. Платёжный баланс: структура и анализ
22. Международные резервы: динамика и управление
23. Влияние глобальных кризисов на финансовые рынки
24. Сравнительный анализ финансовых систем разных стран
25. Мировая финансовая статистика: основные показатели и тенденции
26. Эконометрические модели в финансовой статистике
27. Прогнозирование финансовых кризисов: статистические подходы
28. Big Data и искусственный интеллект в финансовой аналитике
29. Блокчейн и его влияние на финансовую статистику
30. Финансовая грамотность: статистика и методы оценки

5.3. Оценочные средства

Рабочая программа учебной дисциплины «Статистика финансов» обеспечена оценочными средствами для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, включающими контрольные вопросы для проведения промежуточной аттестации, критерии оценивания учебной деятельности обучающихся по балльно-рейтинговой системе, примеры заданий для занятий семинарского типа (практические занятия), билеты для проведения промежуточной аттестации.

Все оценочные средства представлены в Приложении 1.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Оценочные средства разработаны для всех видов учебной деятельности студента – лекций и практических занятий, самостоятельной работы и промежуточной аттестации.

Оценочные средства представлены в виде:

средств текущего контроля: собеседование, контрольная работа, реферат.

средств итогового контроля – промежуточной аттестации: экзамена в 7 семестре.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Клименко И. С.	Системный анализ в управлении: учебное пособие для вузов	Санкт-Петербург: Лань, 2024
Л1.2	Заграновская А. В., Эйсснер Ю. Н.	Теория систем и системный анализ в экономике: учебное пособие для вузов	Москва: Юрайт, 2024

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Кузнецов В. В., Шатраков А. Ю.	Системный анализ: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2024
Л2.2	Алексеева М. Б., Ветренко П. П.	Теория систем и системный анализ: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2024

6.1.3. Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Волкова В. Н., Денисов А. А.	Теория систем и системный анализ: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2024

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
ЛЗ.2	Заграновская А. В., Эйсснер Ю. Н.	Системный анализ: учебное пособие для вузов	Москва: Юрайт, 2024
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	Федеральная служба государственной статистики		
Э2	Центральный банк Российской Федерации		
Э3	Министерство экономического развития Российской Федерации		
Э4	Электронно-библиотечная система BOOK.RU		
Э5	Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН»		
Э6	Электронно-библиотечная система Znanium		
Э7	Научная электронная библиотека eLibrary.ru		
Э8	Ресурсы информационно-аналитического агентства по финансовым рынкам Cbonds.ru		
Э9	СПАРК		
Э10	Единый архив экономических и социологических данных		
6.3.1 Перечень программного обеспечения			
6.3.1.1	Office Professional Plus 2019		
6.3.1.2	Outlook with Business Contact Manager 2010		
6.3.1.3	Project Standard 2019		
6.3.1.4	Windows 10		
6.3.1.5	Windows 7		
6.3.1.6	Windows 8		
6.3.1.7	ПО "Интерне-расширение информационной системы"	Автоматизация управления учебным процессом. Интернет-расширение представляет собой динамический сайт, подключаемый к единой базе данных ИС «Деканат», «Электронные ведомости», «Планы». Данная подсистема обеспечивает:	
6.3.1.8	ПО ""Визуальная студия тестирования"	Автоматизация управления учебным процессом. Позволяет автоматизировать контроль знаний студентов, включая создание набора тестовых заданий, проведение тестирования студентов и анализ результатов.	
6.3.1.9	ПО "Электронные ведомости"	Автоматизация управления учебным процессом. Предназначена для учета и анализа успеваемости студентов.	
6.3.1.10	ПО "Планы"	Автоматизация управления учебным процессом. Позволяет создать в рамках высшего учебного заведения единую систему автоматизированного планирования учебного процесса.	
6.3.1.11	ПО "Деканат"	Автоматизация управления учебным процессом. Предназначена для ведения личных дел студентов.	

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Аудитория	Назначение	Оснащение	Вид
1	Специализированная многофункциональная учебная аудитория № 1 для проведения учебных занятий лекционного и семинарского типов, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной/итоговой аттестации	Столы обучающихся; Стулья обучающихся; Письменный стол педагогического работника; Стул педагогического работника; Кафедра; Магнитно-маркерная доска; Мультимедийный проектор; Экран; Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	

3	Специализированная многофункциональная учебная аудитория № 3 для проведения учебных занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной/итоговой аттестации	Компьютерные столы обучающихся; Стулья обучающихся; Письменный стол педагогического работника; Стул педагогического работника; Стеллаж для учебно-методических материалов, в том числе учебно-наглядных пособий; Многофункциональное устройство (принтер, сканер, ксерокс); Интерактивная доска; Мультимедийный проектор; Ноутбуки с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	
5	Помещение № 5 для самостоятельной работы обучающихся	Письменный стол обучающегося; Стул обучающегося; Письменный стол обучающегося с ограниченными возможностями здоровья; Стул обучающегося с ограниченными возможностями здоровья; Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде лицензиата; Моноблок (в том числе, клавиатура, мышь, наушники) с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	

7	Помещение № 7 для самостоятельной работы обучающихся	Столы; Стулья; Стеллаж для учебно-методических материалов; Многофункциональное устройство (принтер, сканер, ксерокс); Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде лицензиата; Моноблок (в том числе, клавиатура, мышь, наушники) с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	
---	--	---	--

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Методические указания по изучению учебной дисциплины «Статистика финансов» представлены в Приложении 2 и включают в себя:

1. Методические указания для обучающихся по организации учебной деятельности.
2. Методические указания по организации самостоятельной работы обучающихся и выполнения курсовой работы.
3. Методические указания по организации процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.