

ЭМПИРИЧЕСКИЕ И СТАТИСТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ В ФИНАНСАХ

ФИО преподавателя: Матюхина Ирина Николаевна, к.э.н., доц.

Цель освоения дисциплины: В дисциплине обобщаются полученные на уровне бакалавриата общие принципы ведения финансовых расчетов, работы со случайными величинами (характеристики, распределения, вероятности), методы тестирования статистических гипотез, статистические характеристики генеральных совокупностей и выборки. Изучение дисциплины происходит с фокусом на применение указанных методов финансовых расчетов и моделях. Для выполнения большей доли расчетных заданий требуются навыки работы с MS Excel, а также с популярными статистическими пакетами.

Место дисциплины в учебном плане: обязательная, 1 триместр.

Краткое содержание дисциплины:

Тема 1. Стоимость денег во времени, понятие доходности

Тема 2. Базовые статистические понятия в финансовых расчетах

Тема 3. Исследование финансовых числовых данных и их свойств

Тема 4. Основные понятия теории вероятностей

Тема 5. Основные вероятностные распределения и их применение в финансовом анализе

Тема 6. Выборочное исследование и оценка параметров генеральной совокупности

Тема 7. Проверка статистических гипотез

Тема 8. Технический анализ финансовых рынков

Общая трудоемкость дисциплины составляет: 3 зачетные единицы, 108 часов.

Язык преподавания: русский.

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме тестирования.