

Рабочая программа дисциплины

«Эконометрическое моделирование и статистические пакеты для оценки банковских рисков»

Разработчик программы

Хохлов Ю. С.

Аннотация курса

После освоения данного курса слушатели освоят основные методы построения эконометрического моделирования. Из большого числа имеющихся методов особое внимание будет уделено тем, которые наиболее часто используются при анализе экономических, в первую очередь банковских рисков. Слушатели получат навыки практической работы с одним из наиболее популярных в настоящее время статистических пакетов – EViews. Все иллюстративные примеры будут связаны с анализом и оценкой банковских рисков. Предполагается, что слушатели знакомы с основами теории вероятностей и математической статистики, о особенно глубоких познаний не требуется.

1. Образовательно-профессиональные требования к дисциплине

1.1. Место дисциплины в системе подготовки с указанием цикла и специальности.

Преподавание данной дисциплины необходимо для того, чтобы

Обеспечить слушателей знаниями о современных методах построения эконометрических моделей при оценке банковских рисков.

1.2. В результате усвоения дисциплины - “Эконометрическое моделирование и статистические пакеты для оценки банковских рисков” слушатель

- Освоит основные методы построения эконометрических моделей.
- Ознакомится с основными моделями временных рядов.
- Освоит один из статистических пакетов для анализа временных рядов (EViews).
- Получит навыки анализа и управления банковских рисков.
- Научится строить собственные модели для анализа рисков конкретного банка на основе эконометрической теории.

2. Глобальная цель дисциплины

Подготовка квалифицированных специалистов, владеющих методами эконометрического моделирования в задачах управления рисками.

3. Содержание и объем дисциплины

“Эконометрическое моделирование и статистические пакеты для оценки банковских рисков” – 72 часа.

3.1. Наименование тем и распределение часов.

Номер темы	Название темы	Кол-во часов
		лекц.
1	Понятие об эконометрическом моделировании.	2
2	Линейная регрессия и ее оценка.	4
3	Проверка гипотез о параметрах.	4
4	Основные модели временных рядов.	4
5	Модели стационарных временных рядов.	4
6	Модели нестационарных временных рядов.	4
7	Коинтеграция временных рядов.	4
8	Факторные модели при формировании портфеля.	4
9	Обзор свойств некоторых статистических пакетов и их сравнение.	2
	ИТОГО	32
		Семинары
1	Ознакомление с пакетом EViews	2
2	Линейная регрессия и ее оценка	4
3	Стационарные временные ряды и их оценивание.	4
4	Нестационарные временные ряды и их оценивание	4
5	Оценка вероятности дефолта банка и рейтинги банков.	4
6	Оценка кредитоспособности потенциального клиента.	2
7	Расчет VaR и CVaR по эмпирическим данным	4
8	Управление рисками и их снижение на основе факторных моделей	4
9	Выделение коинтегрированных рядов и формирование портфеля.	4
	ИТОГО	32
ВСЕГО		64