

## 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
	<b>ИТОГО</b>	<b>32</b>
		<b>Семинары</b>
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
	<b>ИТОГО</b>	<b>32</b>
<b>ВСЕГО</b>		<b>64</b>