

**ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**УЧЕТНО-ФИНАНСОВЫЙ ФАКУЛЬТЕТ**

**Кафедра экономической статистики**

**УТВЕРЖДАЮ:**

Проректор по научно-методической  
и учебной работе

\_\_\_\_\_  
Е.И. Скафа

\_\_\_\_\_  
2019 г.



**Рабочая программа учебной дисциплины**  
**«ЭКОНОМИКО-СТАТИСТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ АНАЛИЗА**  
**ФИНАНСОВОЙ СФЕРЫ»**

Направление подготовки:	38.04.01 Экономика
Магистерская программа:	Прикладная статистика
Программа подготовки:	Академическая магистратура
Квалификация:	Магистр
Форма обучения:	Очная

Донецк 2019

УТВЕРЖДАЮ:

И.о. декана учетно-финансового  
факультетаН.В. Алексеенко  
" 10 " апреля 2019 г.

Программа составлена с учетом Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 30 марта 2015г. № 321 (с изменениями и дополнениями от 13 июля 2017г.).

Программа учебной дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» составлена на основе ГОС ВПО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утвержденного приказом Министерства образования и науки Донецкой Народной Республики от 13 июля 2016г. № 757, зарегистрированного в Министерстве юстиции ДНР от 08 августа 2016г. № 1460, «Порядка организации учебного процесса в образовательных организациях высшего профессионального образования Донецкой Народной Республики», утвержденного приказом Министерства образования и науки Донецкой Народной Республики от 10.11.2017г. № 1171, учебного плана по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (магистерская программа: Прикладная статистика), утвержденного Ученым Советом университета от 02.04.2019г., протокол № 3.

Разработчик:

Кандидат экономических наук,

доцент кафедры экономической статистики \_\_\_\_\_ Н.А. Юрина

Программа учебной дисциплины утверждена на заседании кафедры экономической статистики

Протокол № 9 от "08" апреля 2019 г.

Заведующий кафедрой

экономической статистики \_\_\_\_\_

Н.А. Юрина

Программа учебной дисциплины одобрена учебно-методической комиссией учетно-финансового факультета

Протокол № 8 от "09" апреля 2019 г.

Председатель учебно-методической  
комиссии учетно-финансового факультета \_\_\_\_\_

А.А. Блажевич

## 1. Область применения и место дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» в учебном процессе.

Учебная дисциплина «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» по направлению подготовки 38.04.01 Экономика. Для студентов направления подготовки 38.04.01 Экономика (магистерская программа: Прикладная статистика) дисциплина реализуется кафедрой «Экономическая статистика».

Для изучения данной учебной дисциплины необходимы знания, умения и навыки, формируемые предшествующими и сопутствующими дисциплинами: «Политическая экономия», «Линейная алгебра», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Деньги, кредит, банки», «Финансы», «Статистика», «Пакеты прикладных программ в статистике», «Банковская статистика», «Финансовая статистика», «Статистическое моделирование и прогнозирование», «Макроэкономика (продвинутый курс)», «Статистическое обеспечение управления», «Мониторинг внешнеэкономической деятельности», «Бизнес-статистика», «Информационно-статистическое обеспечение консалтинговой деятельности».

Знания, умения и навыки, приобретаемые в процессе изучения дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» будут полезны магистру в процессе прохождения преддипломной практики, при подготовке и защите магистерской диссертации.

## 2. Структура дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»

Характеристика учебной дисциплины	
Направление подготовки	38.04. 01 Экономика
Магистерская программа	Прикладная статистика
Программа подготовки	Академическая магистратура
Квалификация	Магистр
Количество содержательных модулей	1
Дисциплина базовой / вариативной части образовательной программы	Дисциплина по выбору вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)»
Формы контроля	1 модульный контроль, 1 экзамен в 3 семестре
Показатели	очная форма обучения
Количество зачетных единиц (кредитов)	4,5
Количество часов	162
Год подготовки	2
Семестр	3
Аудиторных часов, в том числе	64
- лекционных	16
- практических, семинарских	48
- лабораторных	-
- самостоятельной работы	98
в т.ч. индивидуальное задание	-
Недельное количество часов,	10
в т. ч. аудиторных	4

### 3. Описание дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»

#### Цель и задачи.

**Цель** – сформировать у студентов углубленные теоретические знания и практические навыки применения экономико-статистических методов и приемов для исследования явлений и процессов в финансовой сфере.

**Задачи:** формирование у студентов теоретических знаний по дисциплине; приобретение навыков выполнения расчетов и анализа экономических показателей, которые характеризуют финансовую сферу; умение самостоятельно работать с учебной, методической, научной литературой, нормативными и инструктивными материалами и периодическими изданиями; умение презентовать индивидуальные задания, доклады; заниматься научно-исследовательской деятельностью.

**Требования к результатам освоения дисциплины:** Процесс изучения дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО РФ по направлению подготовки 38.04.01 Экономика:

#### **а) общекультурных (ОК):**

- способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу (ОК-1);
- готовность к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала (ОК-3).

#### **б) общепрофессиональных (ОПК):**

- готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности (ОПК-1).

#### **в) профессиональных (ПК):**

*научно-исследовательская деятельность:*

- способность проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой (ПК-3);

*аналитическая деятельность:*

- способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов (ПК-9);
- способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом (ПК-10);

*организационно-управленческая деятельность:*

- способность разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности (ПК-12).

**В результате изучения учебной дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» студент должен.**

#### **Знать:**

- методики расчета и анализа системы статистических показателей финансовой сферы;
- экономическое содержание показателей финансовой сферы;
- методы выявления взаимосвязей между явлениями и процессами в финансовой сфере;
- приемы исследования закономерностей в развитии экономических процессов финансовой сферы и их прогнозирование.

#### **Уметь:**

- рассчитывать статистические показатели финансовой сферы;
- анализировать полученные результаты;

- оценивать влияние факторов, которые обуславливают существующие тенденции и закономерности развития финансовой сферы;
- разрабатывать сценарные и реализовывать оптимальные управленческие решения относительно развития явлений и процессов финансовой сферы.

**Владеть:**

- приемами и методами статистического анализа процессов, происходящих в финансовой сфере;
- навыками самостоятельной исследовательской работы.

#### **4. Содержание дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» и формы организации учебного процесса**

Дисциплина «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельная работа, контроль знаний студента.

Материал излагается с использованием следующих методов обучения:

- словесные: лекции с применением методов активизации, в том числе проблемные лекции;
- наглядные: во время формирования визуального восприятия теоретического материала;
- практические: во время формирования умений и навыков расчета показателей, их анализа, обобщения;
- репродуктивные и проблемно-поисковые: во время выполнения самостоятельных и индивидуальных заданий.

В процессе проведения лекций и практических занятий для наглядного представления, структурирования, обсуждения, охвата большего объема изучаемого материала используются мультимедийные презентации.

В учебном процессе широко применяются активные и интерактивные формы проведения занятий (анализ конкретных процессов финансовой сферы, дискуссия), внеаудиторная самостоятельная работа, балльно-рейтинговая система оценки успеваемости, личностно-ориентированное обучение, проблемное обучение, блочно-модульное обучение.

Самостоятельная работа студентов предусматривает подготовку к практическим занятиям, изучение учебной, методической, научной литературы, составление логико-структурных схем, расширенной аннотации к аналитической статье, составление конспекта отдельных вопросов, подготовку и защиту презентаций, тезисов научного доклада, научной статьи.

Текущий контроль знаний студентов по дисциплине «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» осуществляется в форме устных опросов, тестовых опросов, письменных самостоятельных работ, статистических диктантов по темам, модульной контрольной работы.

Промежуточный контроль - экзамен.

#### **Содержание дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»**

<b>Порядковый номер и название темы</b>	<b>Краткое содержание темы</b>
<b>Модуль 1</b>	
<b>Тема 1.</b> Теоретические основы дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»	Экономическая сущность, состав и роль финансовой сферы в развитии экономики. Значение экономико-статистических методов в исследовании экономических процессов финансовой сферы. Основные задачи исследования финансовой сферы на современном этапе. Система

	показателей и методы исследования финансовой сферы. Основные органы государственной и ведомственной статистики ДНР, которые осуществляют сбор, систематизацию, обобщение и анализ процессов в финансовой сфере. Роль финансовой отчетности в информационном обеспечении анализа финансовой сферы.
<b>Тема 2.</b> Статистика финансовых результатов деятельности субъектов хозяйствования	Основные источники информации о финансовых результатах деятельности предприятий. Система показателей и методов финансовых результатов деятельности предприятия. Индексный анализ прибыли и рентабельности предприятий. Статистическая оценка платежеспособности и финансовой устойчивости предприятия.
<b>Тема 3.</b> Статистика государственных финансов	Значение статистического изучения государственных финансов. Информационное обеспечение статистики государственных финансов. Бюджетная классификация доходов и расходов государственного бюджета. Статистическое изучение объема, структуры и динамики доходов и расходов бюджета. Оценка сбалансированности бюджета. Методики расчета уровня бюджетного дефицита (профицита) и бюджетного долга. Показатели деятельности бюджетных учреждений.
<b>Тема 4.</b> Статистика международных финансов	Информационная база для формирования платежного баланса. Основные направления анализа платежного баланса. Методы статистического анализа платежного баланса. Задачи статистики валютных курсов. Основные факторы, которые формируют валютные курсы. Средние показатели валютных курсов. Статистические методы исследования и прогнозирование валютных курсов.
<b>Тема 5.</b> Статистика денежного рынка	Понятие, состав и значение денежного рынка. Задачи статистического изучения денежного рынка. Общие показатели денежного обращения. Система статистических показателей денежной массы. Показатели скорости обращения денежной массы. Статистическое изучение прогноза кассовых оборотов. Эмиссия денег, уровень денежной эмиссии. Статистическое изучение купюрного состава денег.
<b>Тема 6.</b> Статистика кредитного рынка	Кредитный рынок как составляющая финансового рынка. Задачи статистического изучения кредита. Статистика объема, состава и динамики кредитных ресурсов и вложений. Статистические показатели обращения кредита. Индексный анализ платности кредита. Оценка эффективности использования кредита на уровне субъекта хозяйствования.
<b>Тема 7.</b> Статистика страхового рынка	Задачи статистического изучения страхового рынка. Источники статистической информации по страховой деятельности. Система показателей статистики страхования. Статистический анализ эффективности деятельности страховых компаний. Оценка рейтинга страховых компаний.
<b>Тема 8.</b> Статистика рынка ценных бумаг и фондовых бирж	Значение и основные направления анализа рынка ценных бумаг. Информационное обеспечение статистики ценных бумаг. Статистическая оценка ценных бумаг, анализ риска и доходности ценных бумаг. Информационное обеспечение статистики фондовой биржи. Система статистических показателей фондовой биржи. Характеристика основных фондовых индексов.

**Тематический план по учебной дисциплине «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»**

Названия содержательных модулей и тем	Количество часов					
	Очная форма					
	всего	в т.ч.				
		лекции	практические	лабораторные	самостоятельная работа	индивидуальная работа
Содержательный модуль 1						
Тема 1. Теоретические основы дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»	20	2	6		12	
Тема 2. Статистика финансовых результатов деятельности субъектов хозяйствования	20	2	6		12	
Тема 3. Статистика государственных финансов	20	2	6		12	
Тема 4. Статистика международных финансов	20	2	6		12	
Тема 5. Статистика денежного рынка	20	2	6		12	
Тема 6. Статистика кредитного рынка	20	2	6		12	
Тема 7. Статистика страхового рынка	20	2	6		12	
Тема 8. Статистика рынка ценных бумаг и фондовых бирж	22	2	6		14	
Итого по содержательному модулю 1	162	16	48		98	

**Темы практических занятий по дисциплине  
«Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»**

№ п/п	Название темы	Количество часов
1.	Теоретические основы дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»	<b>6</b>
2.	Статистика финансовых результатов деятельности субъектов хозяйствования	<b>6</b>
3.	Статистика государственных финансов	<b>6</b>
4.	Статистика международных финансов	<b>6</b>
5.	Статистика денежного рынка	<b>6</b>
6.	Статистика кредитного рынка	<b>6</b>
7.	Статистика страхового рынка	<b>6</b>
8.	Статистика рынка ценных бумаг и фондовых бирж	<b>6</b>
<b>Всего по дисциплине</b>		<b>48</b>

## 5. Самостоятельная работа

### Карточка самостоятельной работы студентов

Тема	Задания СРС, форма контроля	Часы	Количество баллов	Срок выполнения (неделя)
<b>Тема 1.</b> Теоретические основы дисциплины «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»	1. Составление тестов по теме (проверка)  2. Составление таблицы, характеризующей направления деятельности органов государственной и ведомственной статистики по сбору, систематизации и анализу финансовых процессов (проверка)	12	1,5  1,5	2
<b>Тема 2.</b> Статистика финансовых результатов деятельности субъектов хозяйствования	1. Составление тезисов доклада по аналитической статье о финансовых результатах деятельности субъекта хозяйствования (проверка)  2. Подготовка доклада и презентации деятельности субъекта хозяйствования: основные этапы развития (таблица); основные виды деятельности и услуг (схема); анализ основных показателей деятельности (таблицы, графики); основные проблемы и направления развития деятельности (защита).	12	2,0  7,0	3-4
<b>Тема 3.</b> Статистика государственных финансов	1. Выполнение расчетной работы по статистическим показателям бюджета (защита)	12	4,0	5-6
<b>Тема 4.</b> Статистика международных финансов	1. Составление конспекта вопроса об основных статистических методах оценки и прогнозирования валютных курсов (проверка)	12	1,5	7-8
<b>Тема 5.</b> Статистика денежного рынка	1. Сообщение на тему: «Статистическая оценка влияния макроэкономических показателей на объем, динамику денежной массы» (проверка)	12	2,0	9-10
<b>Тема 6.</b> Статистика кредитного рынка	1. Составление аннотации к аналитической статье по статистике кредитного рынка (проверка)	12	1,0	11-12
<b>Тема 7.</b> Статистика страхового рынка	1. Представление рейтинга страховой компании, характеристика системы показателей для его определения (защита)	12	3,0	13-15
<b>Тема 8.</b> Статистика рынка ценных бумаг и фондовых бирж	1. Составление таблицы, характеризующей информационно-аналитическое обеспечение деятельности фондовых бирж (проверка)	14	1,5	16-17
<b>Итого по дисциплине</b>		<b>98</b>	<b>25,0</b>	<b>-</b>



## **6. Контрольные вопросы к промежуточной аттестации (экзамен)**

1. Экономическая сущность, состав и роль финансовой сферы в развитии экономики.
2. Значение экономико-статистических методов в исследовании экономических процессов финансовой сферы.
3. Основные задачи исследования финансовой сферы на современном этапе.
4. Система показателей и методы исследования финансовой сферы.
5. Основные органы государственной и ведомственной статистики ДНР, которые осуществляют сбор, систематизацию, обобщение и анализ процессов в финансовой сфере.
6. Роль финансовой отчетности в информационном обеспечении анализа финансовой сферы.
7. Отображение финансовых процессов в системе национальных счетов.
9. Основные источники информации о финансовых результатах деятельности предприятий.
10. Система показателей и методов финансовых результатов деятельности предприятия.
11. Индексный анализ прибыли и рентабельности предприятий.
12. Статистическая оценка платежеспособности и финансовой устойчивости предприятия.
13. Значение статистического изучения государственных финансов.
14. Информационное обеспечение статистики государственных финансов.
15. Бюджетная классификация доходов и расходов государственного бюджета.
16. Статистическое изучение объема, структуры и динамики доходов и расходов бюджета.
17. Оценка сбалансированности бюджета.
18. Методики расчета уровня бюджетного дефицита (профицита) и бюджетного долга.
19. Показатели деятельности бюджетных учреждений.
20. Информационная база для формирования платежного баланса.
21. Основные направления анализа платежного баланса.
22. Методы статистического анализа платежного баланса.
23. Задачи статистики валютных курсов.
24. Основные факторы, которые формируют валютные курсы.
25. Средние показатели валютных курсов.
26. Статистические методы исследования и прогнозирование валютных курсов.
27. Понятие, состав и значение денежного рынка.
28. Задачи статистического изучения денежного рынка.
29. Общие показатели денежного обращения.
30. Система статистических показателей денежной массы.
31. Показатели скорости обращения денежной массы.
32. Статистическое изучение прогноза кассовых оборотов.
33. Эмиссия денег, уровень денежной эмиссии.
34. Статистическое изучение купюрного состава денег.
35. Кредитный рынок как составляющая финансового рынка.
36. Задачи статистического изучения кредита. Источники информации о кредите.
37. Статистика объема, состава и динамики кредитных ресурсов и вложений.
38. Статистические показатели обращения кредита.
39. Индексный анализ платности кредита.
40. Статистический анализ безналичных расчетов
41. Оценка эффективности использования кредита на уровне субъекта хозяйствования.
42. Задачи статистического изучения страхового рынка.
43. Источники статистической информации по страховой деятельности.
44. Система показателей статистики страхования.
45. Статистический анализ эффективности деятельности страховых компаний.
46. Оценка рейтинга страховых компаний.
47. Значение и основные направления анализа рынка ценных бумаг
48. Информационное обеспечение статистики ценных бумаг.
49. Система показателей статистики ценных бумаг.

50. Статистическая оценка ценных бумаг, анализ риска и доходности ценных бумаг.
51. Информационное обеспечение статистики фондовой биржи.
52. Система статистических показателей фондовой биржи.
53. Характеристика основных фондовых индексов.

## 7. Образец экзаменационного билета

ГОУ ВПО «Донецкий национальный университет»

Программа подготовки: академическая магистратура

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Магистерская программа: Прикладная статистика

Семестр: 3-й

Учебная дисциплина: «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»

### БИЛЕТ № \_\_\_\_\_

#### Тесты

1. Какой индекс характеризует изменение средних бюджетных расходов на душу контингента за счет изменения бюджетных расходов на содержание соответствующих контингентов и структуры соответствующих контингентов:

$$1) \frac{\sum b_1 N_1}{\sum N_1} : \frac{\sum b_0 N_0}{\sum N_0}; \quad 2) \frac{\sum b_0 N_1}{\sum N_1} : \frac{\sum b_0 N_0}{\sum N_0}; \quad 3) \frac{\sum b_1 N_1}{\sum b_0 N_0}; \quad 4) \frac{\sum b_1 N_1}{\sum N_1} : \frac{\sum b_0 N_1}{\sum N_1}.$$

2. Общий объем денежной массы можно определить через:

- 1) денежный агрегат  $M_3$ ;
- 2) денежный агрегат  $M_0$ ;
- 3) сумму денежных агрегатов  $M_0$  и  $M_1$ ;
- 4) денежный агрегат  $M_2$ .

3. Укажите формулу, по которой определяется абсолютное изменение скорости обращения денежной массы за счет изменения доли наличных денег в денежной массе:

$$1) (n_1^0 - n_0^0) \cdot d_1^0; \quad 2) n_1 - n_0; \quad 3) (d_1^0 - d_0^0) \cdot n_0^0; \quad 4) (M_1 - M_0) \cdot n_0.$$

4. По какой формуле можно определить средний размер выданных кредитов?

$$1) \frac{K_H + K_K}{2}; \quad 2) \frac{\sum SK}{\sum K}; \quad 3) \frac{\sum Kt}{\sum t}; \quad 4) \frac{\sum Kt}{\sum K}.$$

5. По какой формуле можно определить абсолютное изменение процентных доходов за счет изменения объема предоставленных кредитов?

$$1) \sum K_1 S_1 - \sum K_0 S_0; \quad 2) \sum K_1 S_0 - \sum K_0 S_0; \\ 3) \frac{\sum K_1 S_0}{\sum K_0 S_0}; \quad 4) \sum K_1 S_1 - \sum K_1 S_0.$$

## Задачи

**Задача 1.** Имеются данные по акционерной компании за отчетный период:

Показатели	Отчетный период
Акционерный капитал, тыс. ден. ед.	1500
Чистая прибыль, тыс. ден. ед., в т.ч. резервный фонд	180 10
Количество выпущенных акций, тыс. шт. в т.ч. обычных привилегированных	30 28 2
Выплачено дивидендов по привилегированным акциям	10
Выплачено дивидендов по обычным акциям	84
Рыночная цена обычной акции	60

Для оценки качества акций и эффективности вложения средств инвесторов определите следующие показатели:

1) доход на одну акцию; 2) дивиденд на одну акцию; 3) коэффициент выплаты дивидендов; 4) дивидендную отдачу акции; 5) коэффициент котировки. Сделайте выводы.

**Задача 2.** Имеются следующие данные о ВВП и размере денежной массы страны за два года:

Показатели	Базисный год	Отчетный год
ВВП	913,3	1094,6
Деньги вне банка	157,0	182,9
Денежная масса	484,8	596,8

Определите: 1) скорость и время обращения денежной массы за каждый год; 2) абсолютное изменение оборачиваемости денежной массы – общее и в том числе под влиянием изменения: а) доли наличности; б) скорости обращения наличности. Сделайте выводы.

Утверждено на заседании кафедры «Экономическая статистика»

Протокол № \_\_\_\_\_ от „\_\_\_\_\_” \_\_\_\_\_ 20\_\_\_\_ года

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ **Н.А. Юрина**

Экзаменатор \_\_\_\_\_ **Н.А. Юрина**

Структура экзаменационного билета включает 5 тестовых заданий, 2 практических задания. Правильный ответ на тестовое задание оценивается в 2 балла (за пять правильных ответов – **10 баллов**). Правильный ответ на практическое задание оценивается в **15 баллов** (за два правильно решенных задания – **30 баллов**).

Максимальное количество баллов, которое может быть получено за экзаменационную работу, составляет **40 баллов**.

## 8. Образец тестового задания (для текущего контроля)

### Пример тестовых заданий для опроса ВАРИАНТ

1. Укажите сущность страхования:

- 1) система экономических отношений по защите имущественных интересов предприятий и населения на основе формирования денежных фондов, предназначенных для возмещения материального ущерба;
- 2) способ снижения последствий убытков от событий, предусмотренных договором страхования;
- 3) специфический вид финансовой деятельности, целью которого является защита интересов физических и юридических лиц;
- 4) все перечисленное выше верно.

2. По какой формуле рассчитывается средняя страховая сумма застрахованных объектов?

- 1)  $\frac{S}{N}$ ;
- 2)  $\frac{\bar{W}}{S}$ ;
- 3)  $\frac{P}{N}$ ;
- 4)  $\frac{S_n}{n}$ .

3. По какой формуле рассчитывается средняя страховая сумма пострадавших объектов?

- 1)  $\frac{S}{N}$ ;
- 2)  $\frac{\bar{W}}{S}$ ;
- 3)  $\frac{P}{N}$ ;
- 4)  $\frac{S_n}{n}$ .

4. По какой формуле рассчитывается средний страховой платеж?

- 1)  $\frac{S}{N}$ ;
- 2)  $\frac{\bar{W}}{S}$ ;
- 3)  $\frac{P}{N}$ ;
- 4)  $\frac{S_n}{n}$ .

5. Что характеризует средняя страховая сумма пострадавших объектов?

- 1) на какую сумму в среднем застрахован один объект;
- 2) на какую сумму в среднем застрахован один объект из числа пострадавших;
- 3) какое возмещение выплачено в среднем по одному договору страхования;
- 4) какая часть выплачена страховщиком от той суммы, на которую были застрахованы объекты.

### ВАРИАНТ

1. Что означает сальдо прихода-расхода денег в кассы Центрального банка?

- 1) разность между поступлением и выдачей наличных денег через кассы банка;
- 2) выдачу подкреплений учреждениям банка;
- 3) подкрепление оборотной кассы из резервных фондов банка;
- 4) изъятие денег в резервные фонды банка.

2. Какой показатель определяется отношением сальдо прихода-расхода наличных денег к сумме расхода денег?

- 1) купюрное строение денежной массы;
- 2) скорость обращения денег;
- 3) уровень денежной эмиссии;
- 4) абсолютная сумма денежной эмиссии.

3. Как определяется число оборотов наличных денег (скорость обращения)?

- 1)  $\frac{ВВП}{M_2}$ ;
- 2)  $\frac{(t_1 - t_0) \cdot \Pi_1}{D}$ ;
- 3)  $\frac{ВВП}{M_0}$ ;
- 4)  $\frac{ВВП}{n}$ ,

где  $\Pi$  – поступление денег в кассы банка

4. По какой формуле можно определить продолжительность одного оборота денежной массы?

$$1) \frac{(t_1 - t_0) \cdot \Pi_1}{D}; \quad 2) \frac{D}{n} = \frac{D \cdot \bar{M}}{ДН - \Pi_0} = \frac{D \cdot \bar{M}}{\Pi}; \quad 3) \frac{ДН - \Pi_0}{\bar{M}} = \frac{\Pi}{\bar{M}}; \quad 4) \frac{ВВП}{n}$$

5. По какой формуле определяется сумма изъятых (или дополнительно выпущенных) из обращения денег в результате ускорения (замедления) оборачиваемости?

$$1) \frac{(t_1 - t_0) \cdot \Pi_1}{D}; \quad 2) \frac{1}{2} \frac{\sum t' ДН'}{\sum ДН'}; \quad 3) \frac{ВВП}{n}; \quad 4) \frac{\sum \Pi}{n}.$$

### Содержательный модуль № 1 по дисциплине «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы»

#### Вариант №

1. По какой формуле рассчитывается средний страховой платеж:

$$1) \frac{S}{N}; \quad 2) \frac{\bar{W}}{S}; \quad 3) \frac{P}{N}; \quad 4) \frac{S_n}{n}.$$

2. Какой показатель определяется по формуле  $\frac{K_H + K_K}{2}$  ?

- 1) средний размер предоставленного кредита за месяц;
- 2) средний остаток задолженности по кредиту за год;
- 3) средний остаток задолженности по кредиту за месяц;
- 4) удельный вес просроченной задолженности в объеме выданных кредитов.

3. Какой показатель можно определить соотношением рыночной и номинальной цены акции:

- 1) эмиссионную цену акции;
- 2) размер дивиденда;
- 3) ставку дивиденда;
- 4) курс акции или коэффициент котировки.

4. Что такое прямая валютная котировка?

- 1) 1, 10 или 100 единиц иностранной валюты равняются X единицам национальной валюты;
- 2) 1, 10 или 100 единиц национальной валюты равняются X единицам иностранной валюты;
- 3) выражение курсов двух валют друг к другу через курс каждой из них, рассчитанной по отношению к одной и той же третьей валюте;
- 4) разница между курсом продажи и приобретения валюты.

5. По какой формуле определяется чистый спред?

$$1) \frac{D_o - P_o}{\bar{A}_{\text{раб}}}; \quad 2) \frac{Д_{\text{проц}}}{A, \text{ по котор получ проц}} - \frac{P_{\text{проц}}}{\Pi, \text{ по котор уплач проц}};$$

$$3) \frac{\Pi_{\text{д/но}}}{\sum D}; \quad 4) \frac{ЧП}{СК}.$$

**Задача 1.** Имеются данные о доходах и расходах страховой компании:

№ п/п	Показатели	млн.руб.	
		Базисный период	Отчетный период
1	Поступления страховых взносов по прямому страхованию	290,9	304,3
2	Средства, привлеченные из резервов по накопительным и рисковому видам страхования	27,3	28,2
3	Доходы, полученные от операций перестрахования	22,3	25,2
4	Доходы, полученные от нестраховой деятельности	2,4	4,1
5	Выплаты страхового возмещения и страховых сумм по прямому страхованию	255,6	254,5
6	Расходы на ведение дела	24,3	24,6
7	Отчисления в резервы по накопительным и рисковому видам страхования	16,3	16,7
8	Выплаченные страховые премии по рискам, переданным в перестрахование	20,5	23,5
9	Уставный фонд	168,5	198,9

Определите: 1) рентабельность страховой деятельности за отчетный период; 2) рентабельность перестрахования за отчетный период; 3) абсолютное изменение валовой прибыли – общее и в том числе, обусловленное изменением: а) общей рентабельности страховой организации; б) уставного фонда. Сделайте выводы

**Задача 2.** Акция номиналом 600 руб. была приобретена за 900 руб. и продана через год за 950 руб. Ставка дивиденда составляет 20% годовых.

Определите: 1) совокупную доходность по акции; 2) коэффициент дивидендной отдачи; 3) ценность акции; 4) рендит. Сделайте выводы.

## 10. Критерии оценивания

### Распределение баллов, которые получают студенты

Посещение занятий	Выполнение домашних заданий	Аудиторная работа	Самостоятельная работа	Модульная контрольная работа	Экзамен	Общее количество баллов
2	3	15	25	15	40	100

*Текущий контроль знаний* предусматривает сдачу студентами содержательного модуля. В состав модуля включены: организационно-учебная и самостоятельная работа студентов, выполнение модульной контрольной работы по темам модуля.

*Организационно-учебная работа студентов* учитывает уровень знаний, который продемонстрирован в ответах и выступлениях на практических занятиях, результаты экспресс - контроля (тестовые опросы, статистические диктанты, письменные самостоятельные работы), результаты выполнения домашних заданий, регулярность посещения занятий и активную работу во время занятий. Оценивание выполнения работ осуществляется по следующим критериям: за работу в аудитории – **15 баллов**; за систематическое посещение занятий – **2 балла**; за выполнения домашнего задания – **3 балла**.

*Самостоятельная работа студента* предусмотрена планом самостоятельной работы. Она включает составление тестов, статистических таблиц, расширенной аннотации к аналитической статье, составление конспекта отдельных вопросов, подготовку и защиту презентаций, тезисов научного доклада. Выполнение этих заданий оценивается в **25 баллов**.

*Выполнение модульной контрольной работы* – **15 баллов**.

*Модульная контрольная работа* включает 5 тестовых заданий и 2 задачи. Правильный ответ на тест оценивается в 1 балл (за пять правильных ответов – **5 баллов**); каждая верно решенная задача – 5 баллов (за два правильно решенных задания – **10 баллов**).

Максимальное количество баллов, которое может быть получено за контрольную работу, составляет **15 баллов**.

Максимальное количество баллов, которое может быть получено по текущему контролю знаний, составляет **60 баллов**.

#### Критерии оценивания знаний студентов

#### Критерии оценивания знаний студентов при приеме экзамена (оценивается в 40 баллов)

Для оценки экзамена преподаватель руководствуется следующими принципами:

**40 баллов** - показаны систематические и глубокие знания при ответе на теоретические вопросы билета, выполнена практическая часть билета в полном объеме;

**30 баллов** - показаны систематические и глубокие знания при ответе на теоретические вопросы билета, выполнена практическая часть билета в полном объеме, но при ответе допущены несущественные ошибки;

**20 баллов** – показаны не систематические и не глубокие знания при ответе на теоретические вопросы билета, практическая часть билета выполнена не в полном объеме, при ответе допущено несколько существенных ошибок;

**10 баллов** - показаны поверхностные знания при ответе на теоретические вопросы билета, практическая часть билета не выполнена, при ответе допущено много существенных ошибок; отсутствуют ответы на простые вопросы по знанию основных определений и формул, воспроизведены отдельные фрагменты материала с помощью экзаменатора.

**0** - полное незнание материала по экзаменационной дисциплине.

#### Шкала оценивания: государственная и ECTS

Сумма баллов по всем видам учебной деятельности	Оценка ECTS	Оценка по государственной шкале	
		для экзамена, дифференцированного зачета, курсовой работы, практики	для зачета
90 - 100	<b>A</b>	<b>5</b> (отлично)	зачтено
80-89	<b>B</b>	<b>4</b> (хорошо)	
75-79	<b>C</b>		
70-74	<b>D</b>	<b>3</b> (удовлетворительно)	
60-69	<b>E</b>		
35-59	<b>FX</b>	<b>2</b> (неудовлетворительно) с возможностью повторной пересдачи	не зачтено с возможностью повторной пересдачи
0-34	<b>F</b>	<b>2</b> (неудовлетворительно) с возможностью повторной сдачи при условии обязательного набора дополнительных баллов	не зачтено с возможностью повторной сдачи при условии обязательного набора дополнительных баллов

#### 11. Материально-техническое обеспечение учебного процесса

Для проведения **лекционных и практических занятий** требуется отдельная аудитория на группу, оборудованная меловой или интерактивной доской и мультимедийным проектором. Также необходимы учебные, учебно-методические пособия, слайды презентаций, компьютерные демонстрации материалов лекций; технические и электронные средства обучения и контроля знаний студентов: компьютерное оборудование с лицензионным программным обеспечением, мультимедийное оборудование.

Лекционные и практические занятия по дисциплине «**Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы**» проводятся в учебной лаборатории «Прикладная

статистика» кафедры «Экономическая статистика», которая предназначена для проведения занятий лекционного типа, практических занятий, текущего контроля и промежуточной аттестации (ауд. № 411, г. Донецк, ул. Челюскинцев, д. 198а), оснащенной комплектом учебной мебели на 30 посадочных мест, комплектом рабочего места преподавателя, магнитно-маркерной доской, 1 мультимедийным проектором, 1 ноутбуком, 2 персональными компьютерами с выходом в сеть интернет, 2 стендами.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся:

- методический кабинет учетно-финансового факультета (ауд. № 105, г. Донецк, ул. Челюскинцев, д. 198а), оснащенный комплектом учебной мебели на 35 посадочных мест, компьютер в комплекте с выходом в сеть интернет (4 шт.); учебные, учебно-методические и дидактические материалы для организации учебного процесса по экономике в образовательных организациях высшего образования;

- учебная лаборатория «Прикладная статистика» кафедры «Экономическая статистика» (ауд. № 411, г. Донецк, ул. Челюскинцев, д. 198а), которая оснащена комплектом учебной мебели на 30 посадочных мест, комплектом рабочего места преподавателя, магнитно-маркерной доской, 1 мультимедийным проектором, 1 ноутбуком, 2 персональными компьютерами с выходом в сеть интернет; учебные, учебно-методические и дидактические материалы для организации учебного процесса по экономике в образовательных организациях высшего образования;

- читальный зал № 3 авторефератов и диссертаций (Учебный корпус № 4, 4а, пр. Театральный, д. 13, каб. 106), оснащенный комплектом учебной мебели на 50 посадочных мест, компьютер в комплекте (2 шт);

- читальный зал № 4 периодической литературы (Учебный корпус № 1, ул. Университетская, д. 24, к. 19), оснащенный комплектом учебной мебели на 31 посадочное место, компьютер в комплекте (1 шт);

- зал электронной информации (ауд. № 104а: г. Донецк, пр. Гурова, 6), оснащенный комплектом учебной мебели на 40 посадочных мест, компьютеры в комплекте (14 шт.);

- читальный зал справочно-библиографической и информационной работы (ауд. № 102: г. Донецк, пр. Гурова, 6), оснащенный комплектом учебной мебели на 23 посадочных места, компьютер в комплекте (1 шт).

## 12. Рекомендованная литература

№ п/п	Наименование	Кол-во экземпляров в библиотеке ДонНУ	Наличие электронной версии в ЭБС
<b>Основная литература</b>			
1.	Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов направления подготовки 38.04.01 Экономика (магистерская программа: Прикладная статистика)/ составитель Н.А. Юрина. – Донецк: ДонНУ, 2019. – Электронные данные (1 файл).	-	+
2.	Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие для студентов направления подготовки 38.04.01 Экономика (магистерская программа: Прикладная статистика) /составитель Н.А. Юрина. – Донецк: ДонНУ, 2019. – Электронные данные (1 файл).	-	+
<b>Дополнительная литература</b>			
3.	Дианов Д.В. Статистика финансов и кредита [Электронный ресурс]: учебник / Д.В. Дианов, Е.А. Радугина, Е.Н. Степанян; под ред. Д.В. Дианова. — 2-е изд., стер. — М.: КНОРУС, 2012. — 328 с. - Электронные данные (1 файл).	-	+
4.	Жуков, Е. Ф. Банковское дело [Электронный ресурс]: учебник/ Е. Ф. Жуков и др.; под ред. Е. Ф. Жукова, Ю. А. Соколова. — М.: Издательство Юрайт, 2015. — 591 с. - Электронные данные (1 файл).	-	+
5.	Инновационный менеджмент: учебник/А. И. Базилевич, Л. В. Бобков, Л. К.	2	-



	Вьюгина и др.; под ред. В. Я. Горфинкеля, Т. Г. Попадюк. - Москва: Проспект, 2014. - 422 с		
6.	Киселева, Н.П. Методология статистического анализа конъюнктуры финансового рынка [Электронный ресурс]: монография / Н.П. Киселева, О.Г. Третьякова. – Москва: КНОРУС, 2019. – 186 с. - Электронные данные (1 файл).	-	+
7.	Козлов, В. Н. Системный анализ, оптимизация и принятие решений: учебное пособие / В. Н. Козлов; Санкт-Петербургский гос. политехн. ун-т. - Москва: Проспект, 2014. - 173 с.	2	-
8.	Куприянов, Ю.В. Модели и методы диагностики состояния бизнес-систем [Электронный ресурс]: учеб. пособие/ Ю.В. Куприянов, Е.А. Кутлунин. – М.: Издательство Юрайт, 2019. – 128 с. - Электронные данные (1 файл).	-	+
9.	Лялин, В. А. Рынок ценных бумаг: учебник / В. А. Лялин, П. В. Воробьев. - Изд. 2-е. - Москва: Проспект, 2015. - 398 с.	3	-
10.	Мотовилов, О. В. Банковское дело: учебник / О. В. Мотовилов, С. А. Белозеров. - Москва: Проспект, 2015. - 408 с.	5	-
11.	Палий, И. А. Прикладная статистика: учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по направлению "Техн. науки" и социал.-экон. специальностям / И. А. Палий. - Москва: Наука Спектр: Дашков и К, 2010. - 222 с.	3	-
12.	Современные финансовые рынки: монография / В. С. Воронов и др.; под ред. В. В. Иванова. - Москва: Проспект, 2014. - 571 с.	1	-
13.	Статистика: учебник / И. И. Елисеева и др.; под ред. И. И. Елисеевой. - Москва: Проспект, 2015. - 444 с.	5	-
14.	Финансово-аналитические инструменты устойчивого развития экономических субъектов [Электронный ресурс]: учебник / коллектив авторов; под ред. О.В. Ефимовой. – Москва: КНОРУС, 2019. – 178 с. - Электронные данные (1 файл).	-	+

### 13. Информационные ресурсы

1. Вопросы статистики – М.: ИНФОРМАЦИОННО-ИЗДАТЕЛЬСКИЙ ЦЕНТР "СТАТИСТИКА РОССИИ" [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://voprstat.elpub.ru/jour/issue/archive>
2. Вестник Московского университета. Серия 6. Экономика. – М.: Изд-во Московского гос. ун-та [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog/>.
3. Вестник Донецкого национального университета [Текст]: научный журнал. Серия В. Экономика и право [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [http://donnu.ru/science/journals\\_](http://donnu.ru/science/journals_)
4. Научная библиотека ГОУ ВПО «ДонНУ». – Режим доступа: <http://library.donnu.ru>.
5. Официальный сайт Центрального банка ДНР. – Режим доступа: <http://cbr-dnr.ru/>
6. Официальный сайт Центрального банка России. - Режим доступа: <http://www.cbr.ru/>
7. Официальный сайт Министерства экономического развития ДНР. - Режим доступа: <http://mer.govdnr.ru/>
8. Официальный сайт Министерства финансов ДНР. - Режим доступа: <http://minfindnr.ru/>
9. Официальный сайт Министерства финансов Российской Федерации. – Режим доступа: <http://minfin.ru/>
10. Официальный сайт Министерства доходов и сборов ДНР. - Режим доступа: <http://mdsdnr.info/>
11. Официальный сайт Главного управления статистики ДНР. - Режим доступа: <http://glavstat.govdnr.ru/>
12. Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики. - Режим доступа: <http://old.gks.ru/>
13. Полные справочники по законодательству Российской Федерации [Электронный ресурс]. – Режим доступа: Консультант плюс – <http://www.consultant.ru>.
14. Статистика и экономика – М: Изд-во ФГБОУВПО «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://statecon.rea.ru/jour/issue/archive>

15. Финансы: Научно-практический журнал. – Москва: Общество с ограниченной ответственностью «КНИЖНАЯ РЕДАКЦИЯ «ФИНАНСЫ» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog>.
16. Финансы и кредит. – М.: ООО «Издательский дом ФИНАНСЫ и КРЕДИТ» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://library.donnu.ru/catalog>.
17. Финансы. Учет. Банки [Электронный ресурс]. – Режим доступа: [http://donnu.ru/science/journals\\_](http://donnu.ru/science/journals_)

#### **14. Программное обеспечение**

1. Windows 7 PRO (корпоративная лицензия ДОННУ № 46484614).
2. Microsoft Office (корпоративная лицензия ДОННУ лицензия № 46472919).
3. Microsoft Visual Studio (лицензия программы DreamSpark для высших учебных заведений).
4. Adobe Acrobat Reader, xPDF, R Studio, Scilab (лицензии GPL, Apache, BSD для свободного программного обеспечения).

Рабочая программа по дисциплине «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» рассмотрена и переутверждена на заседании кафедры с изменениями (без изменений) на 201\_\_\_\_ год.

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_ от \_\_\_\_\_  
Зав.кафедрой \_\_\_\_\_

Рабочая программа по дисциплине «Экономико-статистические методы анализа финансовой сферы» рассмотрена и переутверждена на заседании кафедры с изменениями (без изменений) на 201\_\_\_\_ год.

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_ от \_\_\_\_\_  
Зав. кафедрой \_\_\_\_\_