

Минобрнауки России

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Оренбургский государственный университет»

Кафедра статистики и эконометрики

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

ДИСЦИПЛИНЫ

«Б1.Д.В.16 Банковская и биржевая статистика»

Уровень высшего образования

БАКАЛАВРИАТ

Направление подготовки

01.03.05 Статистика

(код и наименование направления подготовки)

Статистика и управление данными

(наименование направленности (профиля) образовательной программы)

Квалификация

Бакалавр

Форма обучения

Очная

Год набора 2023

Рабочая программа дисциплины «Б1.Д.В.16 Банковская и биржевая статистика» рассмотрена и утверждена на заседании кафедры

Кафедра статистики и эконометрики

наименование кафедры

протокол № 13 от "06" 02 2023 г.

Заведующий кафедрой

Кафедра статистики и эконометрики

наименование кафедры

подпись

расшифровка подписи

 В. Н. Арамосев

Исполнители:

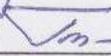
Доцент кафедры статистики и эконометрики

должность

подпись

Т. В. Тимофеева

расшифровка подписи



должность

подпись

расшифровка подписи

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методической комиссии по направлению подготовки

01.03.05 Статистика

код наименование

личная подпись

расшифровка подписи

 В. Н. Арамосев

Заведующий отделом формирования фонда и научной обработки документов

личная подпись

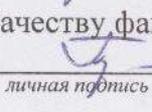
расшифровка подписи

 Н. Н. Бугаева

Уполномоченный по качеству факультета

личная подпись

расшифровка подписи

 Т. В. Тимофеева

№ регистрации _____

1 Цели и задачи освоения дисциплины

Цель (цели) освоения дисциплины: дать слушателям представление об основных концепциях, определениях и показателях статистики банков и бирж; сформировать навыки работы с официальными и альтернативными источниками данных банковской и биржевой статистики; познакомить с практическими возможностями статистического анализа исследования финансово-кредитного механизма деятельности банков и бирж, приоритетными направлениями исследования в данной области в современных условиях.

Задачи:

1. Знакомство с основными теоретическими положениями статистики банков и бирж.
2. Знакомство с особенностями формирования информационного обеспечения банковской и биржевой статистики.
3. Знакомство с возможностями использования статистических методов в анализе показателей банковской и биржевой деятельности.
4. Анализ важнейших характеристик кредитных операций банков, кредитных ресурсов и их использования; важнейших показателей деятельности банков и бирж, как организаций, ведущих хозяйственную деятельность.
5. Приобретение опыта в статистической оценке и анализе процессов, происходящих в банковской и биржевой сферах.

2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к обязательным дисциплинам (модулям) вариативной части блока Д «Дисциплины (модули)»

Пререквизиты дисциплины: *Б1.Д.Б.13.5 Микроэкономическая статистика с основами анализа хозяйственной деятельности, Б1.Д.Б.13.8 Финансовая статистика, Б1.Д.Б.19 Банковское и страховое дело, Б1.Д.В.3 Теория бухгалтерского учета, Б1.Д.В.4 Финансовые рынки и институты, Б1.Д.В.10 Налогообложение*

Постреквизиты дисциплины: *Б2.П.В.П.2 Научно-аналитическая работа*

3 Требования к результатам обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих результатов обучения

Код и наименование формируемых компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций
ПК*-2 Способен проводить опросы домашних хозяйств и предпринимателей в ходе бюджетных обследований, переписей населения и других обследований в соответствии с утвержденными программами, правилами и методиками	ПК*-2-В-3 Проводит первичную обработку переписных и опросных документов, формирует массивы первичных переписных и опросных документов	Знать: приемы и методы проведения статистического наблюдения, способы проведения специально организованных наблюдений Уметь: Проводить специально организованное статистическое наблюдение способом опроса

Код и наименование формируемых компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций
		<u>Владеть:</u> методами проведения опроса в ходе специально организованных наблюдений
ПК*-6 Способен осуществлять сводку статистических данных по утвержденным методикам	ПК*-6-В-2 Осуществляет сводку статистических показателей в соответствии с утвержденными методиками, в т.ч. с использованием цифровых технологий ПК*-6-В-4 Применяет результаты сводки единиц статистической совокупности по заданным признакам для решения профессиональных задач	<u>Знать:</u> приемы и методы проведения сводки статистических показателей банков и бирж, в т.ч. с использованием цифровых технологий <u>Уметь:</u> применять результаты сводки единиц статистической совокупности по заданным признакам в процессе решения профессиональных задач статанализа деятельности банков и бирж <u>Владеть:</u> навыками проведения сводки статистических показателей, в т.ч. с использованием цифровых технологий для решения профессиональных задач статанализа деятельности банков и бирж
ПК*-8 Способен формировать системы взаимосвязанных статистических показателей	ПК*-8-В-3 Применяет сформированные системы взаимосвязанных статистических показателей для решения профессиональных задач	<u>Знать:</u> методы расчета важнейших агрегированных и производных показателей, характеризующих деятельность банков и бирж <u>Уметь:</u> формировать системы взаимосвязанных статистических показателей банков и бирж <u>Владеть:</u> приемами и методами расчета и формирования системы взаимосвязанных

Код и наименование формируемых компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций
		показателей для комплексного статистического анализа процессов, происходящих в банковской и биржевой сферах обоснования полученных выводов

4 Структура и содержание дисциплины

4.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц (216 академических часов).

Вид работы	Трудоемкость, академических часов	
	7 семестр	всего
Общая трудоёмкость	216	216
Контактная работа:	87,25	87,25
Лекции (Л)	52	52
Практические занятия (ПЗ)	34	34
Консультации	1	1
Промежуточная аттестация (зачет, экзамен)	0,25	0,25
Самостоятельная работа: - выполнение индивидуального творческого задания (ИТЗ); - выполнение расчетно-графического задания (РГЗ); - написание реферата (Р); - написание эссе (Э); - самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий); - подготовка к практическим занятиям; - подготовка к коллоквиумам; - подготовка к рубежному контролю и т.п.)	128,75	128,75
Вид итогового контроля (зачет, экзамен, дифференцированный зачет)	экзамен	

Разделы дисциплины, изучаемые в 7 семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		всего	аудиторная работа			внеауд. работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	Предмет, метод и организация статистики банковской деятельности	7	2	2		3
2	Система статистических показателей уровня развития банковского дела	13	4	2		7
3	Статистические методы изучения банковских ресурсов	26	8	4		14
4	Статистика банковских услуг	18	6	2		10

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		всего	аудиторная работа			внеауд. работа
			Л	ПЗ	ЛР	
5	Статистическая оценка финансовых результатов и эффективности деятельности банков	18	6	2		10
6	Методы оценки и регулирования рисков банковских институтов. Кредитный риск	26	8	4		14
7	Предмет и задачи биржевой статистики	6	2	2		4
8	Система показателей статистики фондовых бирж	18	2	2		12
9	Структура доходов фондовых бирж. Статистика производных финансовых инструментов	11	2	2		8
10	Статистические методы в анализе динамики показателей биржевой статистики	20	4	2		14
11	Фондовые индексы и фондовые средние в биржевой статистике	20	4	2		14
12	Индексы акций развитых и формирующихся фондовых рынков	11	2	2		9
13	Особенности расчета российских индексов акций. Международные индексы	11	2	2		9
14	Методы расчета индексов облигаций. Волатильность.	11	2	4		8
	Итого:	216	52	34		130
	Всего:	216	52	34		130

4.2 Содержание разделов дисциплины

Раздел 1. Предмет, метод и организация статистики банковской деятельности.

Задачи банковской статистики, ее место в системе статистических дисциплин, связь с теорией банковского дела. Банковское предпринимательство как объект статистического анализа. Информационное обеспечение банковской статистики. Основные этапы статистического исследования при изучении закономерностей развития банковской сферы.

Раздел 2. Система статистических показателей уровня развития банковского дела.

Блоки основных статистических показателей ЦБ РФ: структуры банковского сектора, достаточности капитала и ликвидности, структуры кредитного портфеля. Система показателей оценки деятельности кредитных организаций: структура и динамика основных направлений деятельности банков. Система группировок и анализ структурных сдвигов в составе банков.

Раздел 3. Статистические методы изучения банковских ресурсов.

Понятие и структура банковских ресурсов. Определение объема, состава и динамики банковских ресурсов. Относительные показатели достаточности собственного капитала банка. Оценка привлеченных и заемных ресурсов банка. Анализ направлений использования ресурсов банка (анализ активных операций). Использование рейтинговых оценок в анализе эффективности использования ресурсов банковскими организациями.

Раздел 4. Статистика банковских услуг.

Классификация услуг коммерческих банков. Статистика сберегательного дела. Система показателей операций банков по вкладам. Индексный анализ изменения общего объема вкладов по совокупности филиалов банка. Факторный анализ среднего размера вклада. Оценка стабильности, эффективности вкладов и склонности населения к сбережению. Показатели банковских кредитов. Методы анализа ссудного процента. Показатели эффективности кредитных вложений. Статистический анализ кредитной активности банка. Индексный анализ эффективности инвестиционной деятельности

Раздел 5. Статистическая оценка финансовых результатов и эффективности деятельности банков.

Абсолютные и относительные показатели финансовых результатов деятельности банка. Методы анализа прибыли банка. Оценка рентабельности и доходности банка. Конкурентные преимущества банка. Статистическое моделирование основных показателей деятельности коммерческих банков. Корреляционно-регрессионный анализ эффективности деятельности банковских организаций. Оценка банковского сектора экономики на основе информационной базы Системы национальных счетов.

Раздел 6. Методы оценки и регулирования рисков банковских институтов. Кредитный риск.

Банковские риски: понятие, причины возникновения, виды, принципы классификации. Элементы системы управления рисками. Опыт Банка России по регулированию банковских рисков. За рубежом опыт управления банковскими рисками. Базельское соглашение. Интегральный показатель совокупного риска банка. Сущность кредитного риска, его специфика. Факторы возникновения кредитного риска. Классические и современные методы статистической оценки кредитного риска.

Раздел 7. Предмет и задачи биржевой статистики.

Понятия фондовой и срочной биржи. История фондового рынка. Предмет и задачи статистики бирж. Особенности формирования первичной финансовой биржевой информации. Формы статистической отчетности о деятельности бирж. Структура информационного обеспечения.

Раздел 8. Система показателей статистики фондовых бирж.

Показатели объема биржевых торгов. Первичный рынок. Объем выпуска. Объем размещения. Объем выручки от продажи. Привлечение средств в бюджет. Вторичный рынок. Средняя сумма биржевых сделок. Структура биржевых сделок. Количество проданных ценных бумаг. Статистические таблицы, используемые в анализе результатов биржевых торгов. Показатели качества фондового биржевого рынка.

Раздел 9. Структура доходов фондовых бирж. Статистика производных финансовых инструментов.

Статистические показатели структуры доходов фондовых бирж. Объем торгов производными финансовыми инструментами в натуральном измерении и по номинальной стоимости. Открытая позиция по производным финансовым инструментам.

Раздел 10. Статистические методы в анализе динамики показателей биржевой статистики.

Динамические ряды цен и доходности - аддитивная и мультипликативная модели. Определении тенденции динамического ряда. Методы сглаживания. Оценка циклической и сезонной компоненты.

Раздел 11. Фондовые индексы и фондовые средние в биржевой статистике.

Цели создания фондовых индексов. Классификация фондовых индексов. Методология расчета индексов цен. Основные типы агрегатных индексов цен. Средняя геометрическая относительных цен. Методология расчета индексов акций. Использование средних геометрических. Фондовые индексы с учетом взвешивания. Формулы Ласпейреса, Пааше, Фишера. Процедуры сопоставления. Ценовые индексы и индексы полной доходности. Влияние методов расчета на динамику индекса.

Раздел 12. Индексы акций развитых и формирующихся фондовых рынков.

Характерные особенности развитых фондовых рынков. Семейства индексов акций: Dow Jones, NYSE, Nasdaq, Standard&Poors, DAX. Алгоритм расчета капитализационно-взвешенного индекса. Особенности методов расчета индексов на формирующихся рынках.

Раздел 13. Особенности расчета российских индексов акций. Международные индексы.

Семейство индексов ММВБ. Сводный фондовый индекс ММВБ. Семейство индексов российской торговой системы и агентства Интерфакс. Семейство фондовых индексов АК&М. Методология

расчета международных индексов. Семейство индексов MSCI. Семейство индексов DowJones Global Indexes. Семейство индексов FTSE All. Индексы акций новых рынков.

Раздел 14. Методы расчета индексов облигаций. Волатильность.

Подходы к построению индексов облигаций на рынке США. Подходы к построению индексов облигаций на рынке Германии. Индикаторы, характеризующие волатильность рынка: волатильность, корреляция, бета-фактор. Расчет показателей волатильности. Расчет коэффициента корреляции. Расчет бета-фактора.

4.3 Практические занятия (семинары)

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	1	Предмет, метод и организация статистики банковской деятельности	2
2	2	Система статистических показателей уровня развития банковского дела	2
3,4	3	Статистические методы изучения банковских ресурсов	4
5	4	Статистика банковских услуг	2
6	5	Статистическая оценка финансовых результатов и эффективности деятельности банков	2
7,8	6	Методы оценки и регулирования рисков банковских институтов. Кредитный риск	4
9	7	Предмет и задачи биржевой статистики	2
10	8	Система показателей статистики фондовых бирж	2
11	9	Структура доходов фондовых бирж. Статистика производных финансовых инструментов	2
12	10	Статистические методы в анализе динамики показателей биржевой статистики	2
13	11	Фондовые индексы и фондовые средние в биржевой статистике	2
14	12	Индексы акций развитых и формирующихся фондовых рынков	2
15	13	Особенности расчета российских индексов акций. Международные индексы	2
16,17	14	Методы расчета индексов облигаций. Волатильность	4
Итого			34

5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Основная литература

1. Салин, В. Н. Биржевая статистика [Текст] : учеб. пособие / В. Н. Салин. - М. : Финансы и статистика, 2003. - 176 с. : ил. - ISBN 5-279-02753-7.
2. Салин, В. Н. Банковская статистика [Текст] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / В. Н. Салин, О. Г. Третьякова. - Москва : Юрайт, 2018. - 215 с. : ил., табл. - (Бакалавр. Магистр). - ISBN 978-5-9916-9627-2.

5.2 Дополнительная литература

1. Леушина, Т. В. Банковская и биржевая статистика [Электронный ресурс] : методические указания для обучающихся по образовательной программе высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика / Т. В. Леушина; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. образования "Оренбург. гос. ун-т", Каф. статистики и эконометрики. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: 0.91 Мб). - Оренбург : ОГУ, 2018. - 80 с. - Загл. с тит. экрана. - Adobe Acrobat Reader 6.0 - Режим доступа: http://artlib.osu.ru/web/books/metod_all/66941_20180601.pdf

2. Минашкин, В. Г. Статистика фондового рынка : учебно-методический комплекс / В. Г. Минашкин. – Москва : Евразийский открытый институт, 2008. – 119 с. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=93219> (дата обращения: 04.04.2023). – ISBN 5-374-00031-4. – Текст : электронный. - Режим доступа: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=93219> .

5.3 Периодические издания

1. Вопросы статистики : журнал. - М. : Агентство "Роспечать", 2023
2. Российский экономический журнал : журнал. - М. : Агентство "Роспечать", 2023.
3. Общество и экономика : журнал. - М. : Агентство "Роспечать", 2023.

5.4 Интернет-ресурсы

- 1 <http://www.gks.ru> - Федеральная служба государственной статистики
- 2 <http://www.cbr.ru>. - Центральный Банк России
- 3 <https://www.finam.ru> - Финам

5.5 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий

1. Операционная система РЕД ОС
2. Пакет настольных приложений LibreOffice
3. Программная система для организации видео-конференц-связи Webinar.ru
4. ГАРАНТ Платформа F1 [Электронный ресурс]: справочно-правовая система. / Разработчик ООО НПП «ГАРАНТ-Сервис», 119992, Москва, Воробьевы горы, МГУ, [1990–2023]. – Режим доступа в сети ОГУ для установки системы: \\fileserver1\GarantClient\garant.exe
5. КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: электронное периодическое издание справочная правовая система. / Разработчик ЗАО «Консультант Плюс», [1992–2023]. – Режим доступа к системе в сети ОГУ для установки системы: [\\fileserver1!\CONSULT\cons.exe](http://fileserver1!\CONSULT\cons.exe)
6. Автоматизированная интерактивная система сетевого тестирования - АИССТ (зарегистрирована в РОСПАТЕНТ, Свидетельство о государственной регистрации программы для ЭВМ №2011610456, правообладатель – Оренбургский государственный университет), режим доступа - <http://aist.osu.ru>

6 Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, для проведения групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Аудитории оснащены комплектами ученической мебели, техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения лабораторных занятий используется компьютерный класс, оснащенный комплектами ученической мебели, доской и компьютерами с обеспечением доступа в электронно-образовательную среду ОГУ.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к сети "Интернет", и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ОГУ.