

Банковская и биржевая статистика

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики минерально-сырьевого комплекса**

Учебный план b010305_25_BA25.plx
Направление подготовки 01.03.05 Статистика

Квалификация **Бакалавр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108
в том числе:
аудиторные занятия 42,25
самостоятельная работа 65,75

Виды контроля в семестрах:
зачеты 8

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	8 (4.2)		Итого	
Неделя	14 5/6			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	14	14	14	14
Практические	28	28	28	28
Иные виды контактной работы	0,25	0,25	0,25	0,25
В том числе инт.	2	2	2	2
Итого ауд.	42,25	42,25	42,25	42,25
Контактная работа	42,25	42,25	42,25	42,25
Сам. работа	65,75	65,75	65,75	65,75
Итого	108	108	108	108

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1.1	Целью изучения учебной дисциплины «Банковская и биржевая статистика» является 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.
-----	---

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП:		ФТД
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Экономика	
2.1.2	Теория статистики	
2.1.3	Макроэкономика	
2.1.4	Промышленная статистика	
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Статистические методы в управлении предприятием	
2.2.2	Статистика финансов	
2.2.3	Экономика данных	
2.2.4	Статистика внешнеэкономических связей	
2.2.5	Статистика полезных ископаемых и геологоразведочных работ	
2.2.6	Статистика качества	
2.2.7	Банковская и биржевая статистика	

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**ПК-7: Способен формировать возможные решения на основе разработанных для них целевых показателей****Знать:**

Уровень 1	Референтные модели оценки систем управления
Уровень 2	Методы структурной декомпозиции процессов
Уровень 3	Принципы и методы трансляции целей организации в показатели процессов

Уметь:

Уровень 1	Анализировать плановые и отчетные показатели системы процессного управления организации
Уровень 2	Производить сравнительный анализ показателей систем процессного управления организаций
Уровень 3	Анализировать имеющиеся ресурсы и составлять перспективные планы развития организаций

Владеть:

Уровень 1	Навыками сбора информации о результатах работы действующей системы процессного управления организации
Уровень 2	Навыками оценки текущих показателей действующей системы процессного управления по принятой модели и определения целевых показателей системы процессного управления организации и ее компонентов
Уровень 3	Навыками оценки соответствия экономической и функциональной эффективности системы процессного управления организации целям системы управления организацией и требованиям к ней

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	наиболее совершенные технологии решения
3.1.2	поставленных задач, исходя из действующих
3.1.3	правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений; инструментарий поиска аналитической
3.1.4	информации, применяя системный подход для
3.1.5	решения профессиональных задач; основы экономической, организационной,
3.1.6	управленческой, социологической и
3.1.7	психологической теории в части работы с
3.1.8	персоналом
3.2	Уметь:
3.2.1	применять знания экономической,

3.2.2	организационной, управленческой,
3.2.3	социологической и психологической теории при
3.2.4	решении профессиональных задач; осуществлять мероприятия,
3.2.5	направленные на реализацию стратегии
3.2.6	управления персоналом, обеспечивать их
3.2.7	документационное сопровождение оценивать
3.2.8	организационные и социальные
3.2.9	последствия
3.3	Владеть:
3.3.1	навыками проведения мероприятий,
3.3.2	направленных на реализацию стратегии
3.3.3	управления персоналом, навыками работы с
3.3.4	документацией по сопровождению
3.3.5	данных мероприятий; навыками применения современных
3.3.6	технологии управления персоналом, навыками
3.3.7	учета и
3.3.8	документационного сопровождения; навыками решения прикладных
3.3.9	экономических задач на основе анализа
3.3.10	информации с применением средств современных
3.3.11	информационных
3.3.12	технологий

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. Предмет, метод и организация статистики банковской деятельности.						
1.1	Задачи банковской статистики, ее место в системе статистических дисциплин, связь с теорией банковского дела. Банковское предпринимательство как объект статистического анализа /Лек/	8	2	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.2	Информационное обеспечение банковской статистики. /Пр/	8	4	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
1.3	Основные этапы статистического исследования при изучении закономерностей развития банковской сферы. /Ср/	8	9	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 2. Система статистических показателей уровня развития банковского дела						
2.1	Блоки основных статистических показателей ЦБ РФ: структуры банковского сектора, достаточности капитала и ликвидности, структуры кредитного портфеля. /Лек/	8	2	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	

2.2	Система показателей оценки деятельности кредитных организаций: структура и динамика основных направлений деятельности банков. Система группировок и анализ структурных сдвигов в составе банков. /Пр/	8	4	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
2.3	Анализ направлений использования ресурсов банка (анализ активных операций). Использование рейтинговых оценок в анализе эффективности использования ресурсов банковскими организациями. /Ср/	8	13	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 3. Раздел 3. Статистика банковских услуг.						
3.1	Классификация услуг коммерческих банков. Статистика сберегательного дела. Система показателей операций банков по вкладам. Индексный анализ изменения общего объема вкладов по совокупности филиалов банка. /Лек/	8	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
3.2	Факторный анализ среднего размера вклада. Оценка стабильности, эффективности вкладов и склонности населения к сбережению. Показатели банковских кредитов. /Пр/	8	6	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	2	
3.3	Методы анализа ссудного процента. Показатели эффективности кредитных вложений. Статистический анализ кредитной активности банка. Индексный анализ эффективности инвестиционной деятельности /Ср/	8	13	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 4. Раздел 4. Статистическая оценка финансовых результатов и эффективности деятельности банков.						
4.1	Абсолютные и относительные показатели финансовых результатов деятельности банка. Методы анализа прибыли банка. Оценка рентабельности и доходности банка. Конкурентные преимущества банка. /Лек/	8	2	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
4.2	Статистическое моделирование основных показателей деятельности коммерческих банков. Корреляционно-регрессионный анализ эффективности деятельности банковских организаций. /Пр/	8	6	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
4.3	Оценка банковского сектора экономики на основе информационной базы Системы национальных счетов. /Ср/	8	9	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 5. Раздел 5. Методы оценки и регулирования рисков банковских институтов. Кредитный риск.						

5.1	Банковские риски: понятие, причины возникновения, виды, принципы классификации. Элементы системы управления рисками. Опыт Банка России по регулированию банковских рисков. За- рубежный опыт управления банковскими рисками. /Лек/	8	3	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
5.2	Базельское соглашение. Интегральный показатель совокупного риска банка. Сущность кредитного риска, его специфика. Факторы возникновения кре- дитного риска. /Пр/	8	6	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
5.3	Классические и современные методы статистической оценки кредитного риска. /Ср/	8	13,75	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 6. Раздел 6. Предмет и задачи биржевой статистики.						
6.1	Понятия фондовой и срочной биржи. История фондового рынка. Предмет и задачи статистики бирж. Особенности формирования первичной финансовой биржевой информации /Лек/	8	1	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
6.2	Формы статисти- ческой отчетности о деятельности бирж. Структура информационного обеспечения. /Ср/	8	4	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
6.3	Структура информационного обеспечения. /Пр/	8	1	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 7. Раздел 7. Фондовые индексы и фондовые средние в биржевой статистике.						
7.1	Цели создания фондовых индексов. Классификация фондовых индексов. Методология расчета индексов цен. Основные типы агрегатных индексов цен. Средняя геометрическая относительных цен. /Лек/	8	1	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
7.2	Методология расчета индексов акций. Использование средних геометрических. Фондовые ин- дексы с учетом взвешивания. Формулы Ласпейреса, Пааше, Фишера. /Ср/	8	4	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
7.3	Процедуры сопоставления. Це- новые индексы и индексы полной доходности. Влияние методов расчета на динамику индекса /Пр/	8	1	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
	Раздел 8. Итоговая аттестация						

8.1	Прием зачета /ИБКР/	8	0,25	ПК-7	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
-----	---------------------	---	------	------	--	---	--

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

5.1. Контрольные вопросы и задания

Контрольные вопросы для подготовки к промежуточной аттестации:

1. Предмет, задачи и методы банковской и биржевой статистики.
2. Система показателей статистики банковской деятельности.
3. Основные источники данных в банковской и биржевой статистике.
4. Показатели ликвидности банка: методика расчета и анализ.
5. Статистика активов и пассивов коммерческого банка.
6. Анализ структуры и динамики кредитного портфеля банка.
7. Статистика депозитной базы: виды вкладов и их динамика.
8. Процентные ставки по кредитам и депозитам: методы статистического анализа.
9. Показатели доходности и рентабельности банковской деятельности.
10. Статистика просроченной задолженности: методы оценки и управления.
11. Рейтинги банков: критерии оценки и значение для статистики.
12. Статистические методы оценки кредитных рисков.
13. Роль Центрального банка в формировании банковской статистики.
14. Биржевая статистика: основные понятия и показатели.
15. Фондовые индексы: методика расчета и значение для анализа рынка.
16. Статистика биржевых котировок: методы анализа динамики цен.
17. Показатели ликвидности и волатильности на биржевом рынке.
18. Статистика объема торгов и оборота рынка ценных бумаг.
19. Корреляционный анализ биржевых инструментов.
20. Статистика производных финансовых инструментов (фьючерсы, опционы).
21. Анализ эффективности инвестиционных стратегий на бирже.
22. Статистика IPO: динамика и факторы успешности размещений.
23. Методы прогнозирования биржевых котировок.
24. Статистика маржинальной торговли: риски и показатели.
25. Сравнительный анализ банковских систем разных стран.
26. Статистика криптовалютных бирж: особенности и тенденции.
27. Анализ концентрации капитала на банковском и биржевом рынках.
28. Применение Big Data и машинного обучения в банковской и биржевой статистике.
29. Статистика банкротств банков: причины и последствия.
30. Современные технологии сбора и обработки финансово-биржевых данных.

Задания для текущего контроля представлены в Приложении 1.

5.2. Темы письменных работ

К письменным работам по дисциплине «Банковская и биржевая статистика» относится реферат.

Примерные темы рефератов::

1. Статистические методы анализа банковской деятельности
2. Показатели ликвидности банков: методика расчета и анализ
3. Статистика кредитного портфеля коммерческих банков
4. Анализ депозитной базы банковской системы
5. Статистика процентных ставок по банковским продуктам
6. Оценка финансовой устойчивости банков: статистические подходы
7. Статистика просроченной задолженности в банковском секторе
8. Анализ динамики активов и пассивов коммерческих банков
9. Статистические методы оценки рисков в банковской деятельности
10. Рейтинги банков: методология составления и анализ
11. Статистика операций банков на фондовом рынке
12. Биржевая статистика: основные показатели и методы анализа
13. Статистика фондовых индексов (PTC, ММВБ, S&P 500 и др.)
14. Анализ динамики курсов акций и облигаций на бирже
15. Статистика биржевых оборотов и ликвидности рынка
16. Волатильность на финансовых рынках: методы измерения
17. Статистика IPO: анализ первичных размещений акций
18. Корреляционный анализ биржевых инструментов
19. Статистика торговых сессий: сравнительный анализ
20. Прогнозирование биржевых котировок с использованием статистических методов
21. Статистика деривативов: фьючерсы и опционы
22. Анализ эффективности инвестиционных стратегий на бирже

23. Статистика маржинальной торговли на бирже
24. Роль Центрального банка в банковской статистике
25. Сравнительный анализ банковских систем разных стран
26. Статистика электронных платежных систем
27. Криптовалютные биржи: статистика торгов и тенденции
28. Статистика банкротств банков: причины и последствия
29. Анализ концентрации капитала на банковском рынке
30. Применение Big Data в банковской и биржевой статистике

5.3. Оценочные средства

Рабочая программа учебной дисциплины «Банковская и биржевая статистика» обеспечена оценочными средствами для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, включающими контрольные вопросы для проведения промежуточной аттестации, критерии оценивания учебной деятельности обучающихся по балльно-рейтинговой системе, примеры заданий для занятий семинарского типа, билеты для проведения промежуточной аттестации.

Все оценочные средства представлены в Приложении 1.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Оценочные средства разработаны для всех видов учебной деятельности обучающегося – занятий семинарского типа (практических занятий), самостоятельной работы и промежуточной аттестации.

Оценочные средства представлены в виде:

средств текущего контроля: проверки решений тестовых заданий, собеседования по теме;

средств итогового контроля – промежуточной аттестации: зачета в 8 семестре.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Пеганова О. М.	Банковское дело: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2023
Л1.2	Курбатов А. Я.	Банковское право России: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2023
Л1.3	Елисеева И. И., Боченина М. В., Бурова Н. В., Михайлов Б. А.	Статистика: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2024

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Боровкова В. А., Балабанов А. И., Боровкова В. А., Бойкова Ю. М.	Банки и банковское дело: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2023
Л2.2	Рождественская Т. Э., Гузнов А. Г., Шамраев А. В.	Банковское право: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2023
Л2.3	Долгова В. Н., Медведева Т. Ю.	Статистика: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2024

6.1.3. Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Алибеков И. Ю.	Теория вероятностей и математическая статистика в среде MATLAB: учебное пособие для вузов	Санкт-Петербург: Лань, 2024
Л3.2	Елисеева И. И., Батырова Д. К., Боченина М. В., Декина М. П., Долотовская О. В., Капралова А. В., Капралова Е. Б., Курышева С. В., Михайлов Б. А., Нерадовская Ю. В., Парик И. Ю., Потахова Л. М., Силаева С. А., Флуд Н. А.	Статистика: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2024

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Электронные ресурсы библиотека МГРИ
----	-------------------------------------

Э2	ООО «Книжный Дом Университета» (БиблиоТех)	
Э3	ООО ЭБС Лань	
Э4	Библиографическая и реферативная база данных SCOPUS	
6.3.1 Перечень программного обеспечения		
6.3.1.1	Office Professional Plus 2019	
6.3.1.2	Windows 10	
6.3.1.3	Windows 7	
6.3.1.4	Windows 8	
6.3.1.5	ПО "Интерне-расширение информационной системы"	Автоматизация управления учебным процессом. Интернет-расширение представляет собой динамический сайт, подключаемый к единой базе данных ИС «Деканат», «Электронные ведомости», «Планы». Данная подсистема обеспечивает:
6.3.1.6	ПО ""Визуальная студия тестирования"	Автоматизация управления учебным процессом. Позволяет автоматизировать контроль знаний студентов, включая создание набора тестовых заданий, проведение тестирования студентов и анализ результатов.
6.3.1.7	ПО "Электронные ведомости"	Автоматизация управления учебным процессом. Предназначена для учета и анализа успеваемости студентов.
6.3.1.8	ПО "Планы"	Автоматизация управления учебным процессом. Позволяет создать в рамках высшего учебного заведения единую систему автоматизированного планирования учебного процесса.
6.3.1.9	ПО "Деканат"	Автоматизация управления учебным процессом. Предназначена для ведения личных дел студентов.

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Аудитория	Назначение	Оснащение	Вид
1	Специализированная многофункциональная учебная аудитория № 1 для проведения учебных занятий лекционного и семинарского типов, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной/итоговой аттестации	Столы обучающихся; Стулья обучающихся; Письменный стол педагогического работника; Стул педагогического работника; Кафедра; Магнитно-маркерная доска; Мультимедийный проектор; Экран; Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	
3	Специализированная многофункциональная учебная аудитория № 3 для проведения учебных занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной/итоговой аттестации	Компьютерные столы обучающихся; Стулья обучающихся; Письменный стол педагогического работника; Стул педагогического работника; Стеллаж для учебно-методических материалов, в том числе учебно-наглядных пособий; Многофункциональное устройство (принтер, сканер, ксерокс); Интерактивная доска; Мультимедийный проектор; Ноутбуки с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	

5	Помещение № 5 для самостоятельной работы обучающихся	Письменный стол обучающегося; Стул обучающегося; Письменный стол обучающегося с ограниченными возможностями здоровья; Стул обучающегося с ограниченными возможностями здоровья; Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде лицензиата; Моноблок (в том числе, клавиатура, мышь, наушники) с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	
7	Помещение № 7 для самостоятельной работы обучающихся	Столы; Стулья; Стеллаж для учебно-методических материалов; Многофункциональное устройство (принтер, сканер, ксерокс); Ноутбук с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде лицензиата; Моноблок (в том числе, клавиатура, мышь, наушники) с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде	

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Методические указания по изучению учебной дисциплины «Банковская и биржевая статистика» представлены в Приложении 2 и включают в себя:

1. Методические указания для обучающихся по организации учебной деятельности.
2. Методические указания по организации самостоятельной работы обучающихся.
3. Методические указания по организации процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.