



# Финансовая эконометрика

## **Преподаватель:**

- Артамонов Дмитрий Вячеславович - к.ф.-м.н., доцент, кафедра Математических методов анализа экономики
- Елицур Дарья Александровна – ассистент, кафедра Математических методов анализа экономики

## **Аннотация дисциплины:**

Дисциплина является логическим продолжением курса «Эмпирические и статистические методы в финансах» 1го триместра и выводит навыки статистического анализа финансовых данных на новый уровень.

Курс начинается с обсуждения элементов пространственной эконометрики, затем подробно разбирается анализ временных рядов, которыми в большинстве своем являются данные с финансовых рынков, а также обсуждаются основанные на этом анализе подходы прогнозирования будущих значений переменных.

В курсе кратко обсуждаются методы имитационного моделирования. Также существенное место в курсе занимает рассмотрение новых тенденции в анализе данных — Big Data и машинное обучение. Для выполнения практических расчетных заданий используется язык программирования R.

**Трудоемкость:**

3 ECTS / 108 часов

**Статус дисциплины:**

Обязательная

**Период обучения:**

2й триместр

**Язык преподавания:**

Русский

**Итоговая аттестация:**

Тестирование

## **Краткое содержание дисциплины по темам:**

1. Классическая модель линейной регрессии
2. Временные ряды, стационарные относительно детерминированного тренда
3. Временные ряды и стационарные относительно детерминированного тренда ряды
4. Имитационное моделирование
5. Работа с реальными данными

