

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Оренбургский государственный университет»

Кафедра статистики и эконометрики

Т.В. Леушина, С.Н. Морозова

ЭКОНОМИКА И СТАТИСТИКА ФИНАНСОВОГО СЕКТОРА

Методические указания

Рекомендовано к изданию редакционно-издательским советом федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Оренбургский государственный университет» для обучающихся по образовательной программе высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 Экономика

Оренбург
2018

УДК 311:336(076.5)
ББК 65.051.526я7
Л52

Рецензент – доцент, кандидат экономических наук О. И. Бантикова

Л52 **Леушина, Т. В.**
Экономика и статистика финансового сектора: методические указания
/ Т. В. Леушина, С.Н. Морозова; Оренбургский гос. ун-т. – Оренбург:
ОГУ, 2018. - 47 с.

В методических указаниях изложены рекомендации по самоподготовке по дисциплине, группового творческого задания, представлены задания для самостоятельной и расчетно-графической (контрольной) работ, тестовые задания для самопроверки, список литературных источников, рекомендуемых для изучения дисциплины.

Методические указания предназначены для обучающихся всех форм обучения направления подготовки 38.04.01 Экономика.

УДК 311:336(076.5)
ББК 65.051.526я7

© Леушина Т.В.,
© Морозова С.Н., 2018
© ОГУ, 2018

Содержание

Введение	4
1 Методические рекомендации по самостоятельной работе	7
2 Самоподготовка по темам дисциплины	10
2.1 Сектор финансовых корпораций в системе национального счетоводства	10
2.2 Основные характеристики финансовых активов и других финансовых инструментов	12
2.3 Статистический учет производных финансовых инструментов	15
2.4 Статистические характеристики финансового рынка	19
2.5 Статистика финансового положения России	22
3 Лабораторная работа	26
3.1 Методические указания	26
3.2 Варианты лабораторных работ	27
4 Расчетно-графическая (контрольная) работа	39
4.1 Методические указания	39
4.2 Комплексные практические задания к расчетно-графической (контрольной) работе	41
5 Литература, рекомендуемая для изучения дисциплины	44

Введение

Финансовый сектор экономики, его структура, типы финансовых институтов и экономические интересы его участников, в результате определяют основные закономерности в формировании национального капитала и, соответственно, тенденции экономического развития страны в целом. Статистические методы изучения финансового сектора экономики представляют собой прикладную дисциплину, в которой анализируются важнейшие показатели, характеризующие состояние, структуру, дифференциацию характеристик домашних хозяйств на макро- и микроуровнях в соответствии с принятой международной методологией. Финансовый сектор анализируется как совокупность взаимосвязанных финансовых институтов, обеспечивающих движение и перераспределение финансовых ресурсов в экономике. Статистико-экономический анализ позволяет комплексно оценить состояние, динамику, современные тенденции изменения институциональной структуры финансового сектора, дифференциацию его компонентов и является важным условием для разработки научно обоснованных прогнозов будущих изменений. В связи с вышесказанным, овладение теоретическими знаниями и практическими навыками в области направлений и приемов анализа статистической информации финансового сектора экономики является важным и необходимым для студентов, обучающихся по программам магистратуры направлений подготовки 38.04.01 Экономика.

Цель изучения дисциплины «Экономика и статистика финансового сектора» - овладение магистрантами методологии статистико-экономического анализа финансового сектора; формирование навыков работы с информационной базой для статистического анализа финансового сектора в целом и отдельных сегментов финансового рынка; познакомить с практическими возможностями применения экономико-статистических методов в исследовании финансового сектора на макроуровне, приоритетными направлениями исследования в данной области в современных условиях..

Цель реализуется последовательным решением следующих задач:

1. Знакомство с основными положениями статистического изучения финансовых корпораций с учетом международных положений и рекомендаций.
2. Знакомство с особенностями использования статистической методологии в финансового сектора экономики.
3. Анализ важнейших показателей, характеризующих финансовый рынок.
4. Приобретение опыта в комплексном статистико - экономическом анализе финансового сектора с учетом закономерностей, определяющих изучаемые процессы.

Методические указания разработаны в соответствии с учебной программой курса. Изучение дисциплины является логическим продолжением курсов «Методология научного исследования», «Макроэкономика (продвинутый курс)», «Финансовый менеджмент».

В результате освоения дисциплины студент должен знать:

- актуальные научные публикации по статистике, включая зарубежные и правила получения доступа к различным источникам статистической информации;
- статистические приемы, методы и модели для самостоятельного исследования социально-экономических процессов и явлений в соответствии с разработанной программой;
- источники статистической информации, включая административные данные, данные государственной статистики, данные коммерческих производителей статистической информации, данные некоммерческих и исследовательских организаций, разного рода технические публикации и обзоры;
- актуальные научные публикации по статистике, включая зарубежные и правила получения доступа к различным источникам статистической информации.

Уметь:

- выявлять перспективные направления статистического исследования социально-экономических процессов и явлений и составлять программу исследова-

ний;

- самостоятельно проводить статистические исследования социально-экономических процессов и явлений в соответствии с разработанной программой;

- работать с научно-технической литературой, в том числе на иностранных языках;

- использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов.

Владеть:

- способностью обобщать и критически оценивать результаты, полученные отечественными и зарубежными исследователями в области статистического анализа социально-экономических процессов и явлений;

- современным статистическим инструментарием для самостоятельного исследования социально-экономических процессов и явлений в соответствии с разработанной программой;

- навыками консультирования потребителей статистических данных по вопросам источников статистической информации и методов их правильного использования;

- способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов.

Сформированные компетенции по данной дисциплине позволят на основе статистических данных с использованием программного обеспечения выявлять и формулировать актуальные проблемы в финансовом секторе экономики.

Основными видами занятий являются лекции и семинары. На лекциях используются вопросы преподавателя студентам и студентов преподавателю, в ходе лекции, использование доски. На семинарах используются тестирование, решение задач, прослушивание студенческих творческих заданий и их обсуждение.

1 Методические рекомендации по самостоятельной работе

Целью самостоятельной работы студента является овладение фундаментальными знаниями, профессиональными умениями и навыками по профилю будущей специальности, опытом творческой, исследовательской деятельности, развитие самостоятельности, ответственности и организованности, творческого подхода к решению проблем учебного и профессионального уровней. Задачи самостоятельной работы студентов: систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений студентов; углубление и расширение теоретической подготовки; формирование умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию и специальную литературу; развитие познавательных способностей и активности студентов: творческой инициативы, самостоятельности, ответственности и организованности; формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации; развитие исследовательских умений; использование материала, собранного и полученного в ходе самостоятельных занятий на практических занятиях, при написании курсовых и выпускной квалификационной работ, для эффективной подготовки к итоговым зачетам и экзаменам.

Методологическую основу самостоятельной работы студента составляет деятельностный подход, при котором цели обучения ориентированы на формирование умений решать типовые и нетиповые задачи, т. е. на реальные ситуации, в которых студентам надо проявить знание конкретной дисциплины.

Для усвоения дисциплины студенты должны самостоятельно проработать рекомендуемую литературу и в целях закрепления теоретических знаний и приобретения практических навыков выполнить индивидуальное творческое задание. Кроме знания программного материала дисциплины, обучающийся должен владеть логическими операциями: сравнения, анализа, синтеза, обобщения, определения понятий, правилами систематизации и классификации. Особое внимание следует обратить на определение основных понятий курса.

Вопросы для самостоятельной работы студентов, указанные в рабочей программе дисциплины, предлагаются студенту в начале изучения дисциплины. Студенты имеют право выбирать дополнительно интересующие их темы для самостоятельной работы.

Полезно составлять опорные конспекты. Опорный конспект представляет собой вид внеаудиторной самостоятельной работы студента по созданию краткой информационной структуры, обобщающей и отражающей суть материала лекции, темы учебника. Опорный конспект призван выделить главные объекты изучения, дать им краткую характеристику, используя символы, отразить связь с другими элементами. Основная цель опорного конспекта – облегчить запоминание. В его составлении используются различные базовые понятия, термины, знаки (символы) – опорные сигналы. Опорный конспект – это наилучшая форма подготовки к ответу и в процессе ответа. Составление опорного конспекта к темам особенно эффективно у студентов, которые столкнулись с большим объемом информации при подготовке к занятиям и, не обладая навыками выделять главное, испытывают трудности при ее запоминании.

Тесты - это система специально подобранных проверочных заданий специфической (тестовой) формы, позволяющая количественно оценить учебные достижения в одной или нескольких областях знаний. Правильные ответы на вопросы тестов требуют не только знаний теории вопроса, но и творческого подхода, умения применять свои знания для решения практических задач.

Решение задач. При самостоятельном решении задач необходимо соблюдать следующие требования:

- перед решением задачи должно быть приведено ее условие;
- решение задач следует сопровождать необходимыми формулами, подробными расчетами, краткими пояснениями, если необходимо – таблицами и диаграммами;
- в расчетах должна соблюдаться достаточная точность вычислений (до 0,1, 0,01, 0,001) в зависимости от исчисляемых показателей;

– все именованные статистические показатели следует выражать в соответствующих единицах измерения;

– необходимо проверять правильность полученных результатов, пользуясь взаимосвязью между исчисленными показателями и формулировать выводы, раскрывающие их экономическое содержание и значение

Для выполнения самостоятельной работы студентам предлагается воспользоваться учебной литературой, которая представлена в списке рекомендуемой литературы или другими источниками по усмотрению студентов.

2 Самоподготовка по темам дисциплины

2.1 Сектор финансовых корпораций в системе национального счетоводства

В ходе освоения данной темы необходимо изучить следующие группы вопросов:

- 1 Сфера охвата.
- 2 Подсектора сектора финансовых корпораций.
- 3 Центральный Банк.
- 4 Другие депозитные корпорации.
- 5 Другие финансовые корпорации.
- 6 Страховые корпорации и пенсионные фонды.
- 7 Другие финансовые посредники.
- 8 Вспомогательные финансовые единицы.

Тестовые задания для самоконтроля

- 1 Вставьте пропущенное слово.

К сектору финансовых корпораций относятся непосредственно финансовые корпорации, включая финансовые квазикорпорации, а также _____ организации, финансируемые и контролируемые финансовыми корпорациями.

- 2 Подсектор вспомогательных финансовых единиц не включает:

- финансовые лизинговые компании;
- компании, осуществляющие обмен валюты;
- корпорации, предоставляющие финансовые гарантии;
- брокеров и агентов.

- 3 Вставьте пропущенное слово.

Компании-носители начали широко использоваться в связи с деятельностью по _____ активов.

4 Корпорации, предоставляющие финансовые гарантии:

- имеют поддающийся определению пул активов, составляющий страховые технические резервы;
- имеют внебалансовые позиции;
- могут не подпадать под меры регулирования как страховые корпорации;
- не могут подвергаться ограничениям относительно конкретных видов финансовых операций, которыми они имеют право заниматься.

5 Вставьте пропущенное слово.

Страховые и пенсионные вспомогательные единицы включают агентов, страховых оценщиков и администраторов _____ работ.

6 Специализированные финансовые посредники не включают

- холдинговые корпорации;
- инвестиционные пулы;
- компании, предоставляющие краткосрочное финансирование операций по слиянию и поглощению корпораций;
- фирмы по финансированию экспорта и импорта;
- факторинговые компании;
- фирмы венчурного капитала.

7 Финансовые структуры, созданные для владения секьюритизированными активами или активами, переданными с балансов корпораций или государственных предприятий в рамках их реструктуризации, называются

- компании-носители;
- холдинговые корпорации;
- инвестиционные пулы;

- депозитарии.

8 Публичные биржи и рынки ценных бумаг представляют собой:

- фирмы венчурного капитала;
- компании-депозитарии ценных бумаг;
- учетные и клиринговые органы;
- финансовые лизинговые компании;
- инвестиционные пулы.

9 Институциональные единицы, которые выступают в форме финансовых организаций, за исключением пенсионных фондов, и которые объединяют средства инвесторов с целью приобретения финансовых активов, называются:

- фирмы венчурного капитала;
- компании-депозитарии ценных бумаг;
- учетные и клиринговые органы;
- финансовые лизинговые компании;
- инвестиционные пулы.

10 Вставьте пропущенное слово.

Финансовые _____ компании занимаются финансированием покупки материальных активов.

2.2 Основные характеристики финансовых активов и других финансовых инструментов

В ходе освоения данной темы необходимо изучить следующие группы вопросов:

1 Понятие финансовых активов.

- 2 Монетарное золото и СДР.
- 3 Наличная валюта и депозиты.
- 4 Ценные бумаги, кроме акций.
- 5 Кредиты и займы.
- 6 Акции и другие формы участия в капитале.
- 7 Страховые технические резервы.
- 8 Производные финансовые инструменты.
- 9 Другая дебиторская/кредиторская задолженность.
- 10 Другие финансовые инструменты.

Тестовые задания для самоконтроля

1 К финансовым активам не относятся:

- наличная валюта;
- депозиты;
- ценные бумаги;
- кредитные линии;
- финансовые гарантии.

2 Вставьте пропущенное слово.

Депозиты включают _____ активы, которые могут быть обменены на наличные по номиналу по первому требованию без каких-либо ограничений, и другие депозиты.

2.3.3 Если монеты из драгоценных металлов или памятные монеты не находятся в активном денежном обращении, они должны классифицироваться как...

- финансовые активы;
- нефинансовые активы;
- депозиты;
- резервные активы.

4 Обещание произнести платеж, когда будут предоставлены определенные документы, оговоренные в контракте, называется

- депозит;
- займ;
- эмиссионная программа;
- аккредитив.

5 К финансовым инструментам не относят

- государственное и другие внешние формы финансирования предприятия;
- денежные средства, ценные бумаги, опционы, форварды, фьючерсы, свопы;
- инструменты инвестирования (акции, инвестиционные сертификаты и т.п.);
- платежные инструменты (платежные поручения, чеки, аккредитивы и т.п.);
- депозитные инструменты депозитные договоры, депозитные сертификаты и т.п.).

6 Вставьте пропущенное слово.

Чистая стоимость средств домашних хозяйств в резервах по страхованию жизни и в пенсионных фондах- это требования держателей страховых полисов в отношении _____ страховых корпораций и пенсионных фондов.

7 Другая дебиторская/кредиторская задолженность не включает:

- коммерческий кредит, предоставленный напрямую корпорациям, органам госуправления, НКО, домашним хозяйствам и остальному миру;
- авансы на работы, которые находятся на стадии незавершенного производства;
- предварительную оплату товаров и услуг;
- аккредитивы;
- кредитные линии.

8 Вставьте пропущенное слово.

Операции с немонетарным золотом классифицируются как операции с _____ активами

9 Вставьте пропущенное слово.

В ходе заключения производного финансового контракта не происходит передачи основной суммы контракта, которая должна была бы впоследствии погашаться, и не осуществляется начисления _____ дохода.

10 Требования держателей страховых полисов в отношении резервов страховых корпораций и пенсионных фондов - это:

- активы сектора домашних хозяйств;
- пассивы сектора домашних хозяйств;
- активы страховых корпораций;
- пассивы пенсионных фондов;
- активы пенсионных фондов.

2.3 Статистический учет производных финансовых инструментов

В ходе освоения данной темы необходимо изучить следующие группы вопросов:

- 1 Концепция и сфера охвата.
- 2 Форвардные контракты.
- 3 Опционы.
- 4 Отражение в учете операций с производными финансовыми инструментами и операций по ним.
- 5 Стоимостная оценка позиций.
- 6 Платежи при заключении и исполнении контракта.

7 Гарантийные депозиты.

8 Учет некоторых производных финансовых инструментов.

9 Контракты с оговоренными процентными ставками.

10 Контракты на поставку оговоренной иностранной валюты.

11 Производные кредитные инструменты.

Тестовые задания

1 Укажите особенности биржевых производных финансовых инструментов:

- обращение ПФИ на биржевой товар связано с обращением базисного товара;
- имеют более рискованный характер, нежели базисный актив;
- риск ПФИ не зависит от риска базисного актива;
- собственная цена ПФИ рассчитывается как доля стоимости базисного актива;
- операции с ПФИ обеспечивают повышенную доходность;
- имеют краткосрочный характер.

2 Укажите положения, отражающие особенности форвардных контрактов:

- цель заключения форвардов - реальная поставка базисного актива;
- типовое содержание контракта;
- базисный актив форварда произвольный;
- не существует вторичного рынка форвардов;
- форварды имеют повышенный риск неисполнения.

3 Укажите положения, отражающие особенности опционных контрактов:

- исключительно стандартный биржевой контракт;
- обращаются на биржевом и внебиржевом рынках;
- покупатель опциона берёт на себя обязательство продажи (покупки) базисного актива и получает премию от продавца опциона;

- продавец опциона берёт на себя обязательство продажи (покупки) базисного актива и получает премию от покупателя опциона.

4 Укажите положения, характеризующие используемые на рынке деривативов стратегии:

- хеджирование - страхование риска неблагоприятного изменения цены актива путём занятия противоположных позиций по данному активу по основанному на нём деривативу;

- спекуляция - покупка актива по низкой цене и продажа через некоторое время по высокой цене;

- спекуляция - одновременная покупка и продажа одного актива на разных рынках по разным ценам;

- арбитраж - одновременная покупка и продажа одного актива на разных рынках по разным ценам.

5 Укажите базисные активы биржевых производных финансовых инструментов:

- массовые универсальные вещественные товары;

- уникальные сертифицированные товары;

- ликвидные ценные бумаги;

- фондовые индексы;

- процентные ставки;

- уровень инфляции.

6 Форвардная цена это:

- цена поставки в форвардных контрактах, которые заключаются в момент поставки;

- цена поставки в форвардных контрактах, которые заключаются в данный момент;

- финансовый результат форвардной сделки;

- цена инвестируемых средств при форвардной сделке;

7 Для определения теоретической форвардной цены необходимо иметь:

- цену продажи актива, возврат инвестированных средств, доход по инвестированным средствам;

- сумму инвестированных средств, форвардную цену актива, сумму дохода по активу;

- цену спот актива, ставку финансирования (инвестирования), форвардную цену актива;

- цену спот актива, ставку финансирования, доходность актива (в % к рыночной цене), форвардную цену актива.

8 Чистая стоимость финансирования это:

- разница между теоретической форвардной ценой и в биржевом фьючерсном контракте;

- разница между стоимостью финансирования и доходностью актива;

- разница между доходами и расходами по форвардной сделке;

- дисконтированная величина будущей цены актива.

9 Укажите различия между фьючерсами и форвардными контрактами:

- объем базового актива, место совершения сделки, поставка, режим текущих расчетов, количество сторон сделки, наличие рисков, варианты хеджирования;

- получение доходов, объем базового актива, место совершения сделки, поставка, режим текущих расчетов, количество сторон сделки, варианты хеджирования;

- штрафные санкции, объем базового актива, место совершенствования сделки, поставка, количество сторон сделки, варианты хеджирования;

- гарантированное поступление продукции, объем базового актива, место совершения сделки, количество сторон сделки, варианты хеджирования.

10 Вставьте пропущенное слово.

Если производные финансовые инструменты продаются на вторичном рынке, независимо от того, биржевой он или внебиржевой, то оценка проводится по _____ ценам

2.4 Статистические характеристики финансового рынка

В ходе освоения данной темы необходимо изучить следующие группы вопросов:

1 Система статистических показателей финансового рынка Федеральной службы государственной статистики.

2 Система показателей валютного рынка.

3 Источники информации и особенности статистического исследования динамики валютных курсов.

4 Прогнозирование валютных курсов.

5 Информационная база и система показателей статистики ценных бумаг.

6 Методы статистического анализа доходности ценных бумаг.

7 Статистический анализ финансовых вложений.

8 Банковская статистика международных финансовых рынков.

Тестовые задания

1 Для статистической оценки вариации валютных курсов рассчитывают:

- среднее квадратическое отклонение;
- коэффициент вариации;
- коэффициент контингенции;
- индекс потребительских цен.

2 Какие методы из нижеперечисленных применяют для выявления тенденции развития явления:

- метод укрупнения интервалов;
- метод параллельных рядов;
- метод скользящей средней;
- метод корреляции рангов;
- аналитическое выравнивание ряда динамики.

3 Веса текущего периода используются при расчете индекса цен

- Ласпейреса;
- Пааше;
- индивидуального;
- Фишера.

4 Вставьте пропущенное слово.

Если объектом торговли является иностранная валюта, а транзакция совершается между резидентами одной страны, то она относится к _____ рынку.

5 Реальный валютный курс находят как отношение номинального курса к индексу ...

- Фишера;
- дефлятору;
- потребительских цен;
- Эджворта-Маршалла.

6 Если первые разности уровней временного ряда (абсолютные приросты) более или менее постоянны, для моделирования тенденции рекомендуется использовать

- параболу второго порядка;
- линейную функцию;

- гиперболу;
- экспоненту;
- параболу третьего порядка.

7 К адаптивным моделям прогнозирования относят

- модели скользящего среднего;
- модели построения кривых роста;
- модели авторегрессии скользящего среднего;
- модели экспоненциального сглаживания.

8 Если временной ряд представляется в виде суммы соответствующих компонент, то полученная модель носит название

- мультипликативной;
- аддитивной;
- тобит-моделью;
- моделью ковариационного анализа.

9 Вставьте пропущенное слово.

При большом периоде колебания считают, что во временных рядах имеет место _____ составляющая.

10 Вставьте пропущенное слово.

Под _____ понимают изменение, определяющее общее направление развития, основную тенденцию временного ряда.

2.5 Статистика финансового положения России

В ходе освоения данной темы необходимо изучить следующие группы вопросов:

- 1 Обобщающие статистические показатели финансового положения России.
- 2 Основные концепции и категории Платежного баланса.
- 3 Источники информации для составления Платежного баланса.
- 4 Структура и стандартные компоненты Платежного баланса.
- 5 Счет текущих операций.
- 6 Счет операций с капиталом и финансовыми инструментами.
- 7 Основные показатели платежной системы РФ.
- 8 Международная инвестиционная позиция и международные резервы.
- 9 Статистика государственного внешнего долга.

Тестовые задания

1 Счет движения капитала в платежном балансе не включает:

- прямые инвестиции;
- факторный доход (процент на капитал и зарплата работающих за рубежом);
- портфельные инвестиции;
- кредиты, ссуды и займы.

2 Ниже приводится список внешнеэкономических операций между Эстонией и другими странами (в млн. долл.): импорт товаров и услуг в Эстонию составил 320, Экспорт товаров и услуг из Эстонии составил 200, Прямые иностранные инвестиции иностранцев в Эстонию 130. Определите изменение резервных активов (валютных резервов) страны:

- рост на 10 млн.;

- снижение на 10 млн.;
- рост на 250 млн.;
- снижение на 250 млн.

3 Что из ниже перечисленного является неверным?

- торговый баланс является составной частью текущего счета платежного баланса;
- предоставление кредитов иностранцам отражается на счете движения капиталов и финансовых операций;
- увеличение резервных активов отражается в платежном балансе со знаком плюс;
- общее сальдо платежного баланса страны, включая изменения в резервных активах, всегда равно нулю;
- если официальные резервы не меняются, то счет текущих операций и счет движения капиталов и финансовых операций взаимно компенсируют друг друга.

5.3.4 Торговый баланс представляет собой:

- всю сумму годового экспорта товаров;
- всю сумму годового импорта товаров;
- разницу между стоимостью экспорта и импорта;
- разницу между суммой всех платежей, полученных страной из-за границы и суммой всех платежей, произведенных ею за рубежом.

5 Выберите из перечисленных вариантов ответов те, которые относятся к методам государственного регулирования платежного баланса:

- прямой контроль над импортом капитала;
- поддержание соотношения между запасами золота и предложением денег в стране;
- дефляция;

- сохранение курса национальной валюты неизменным относительно валют других стран;
- регулирование валютного курса.

6 В каком году МВФ организовал Комитет по статистике платежного баланса?

- 1950;
- 1961;
- 1977;
- 1987;
- 1992;
- 1993.

7 Какие операции должны отражаться в дебите платежного баланса РФ

- экспорт товаров лесопромышленного комплекса из России;
- частные кредиты, предоставленные субъектами американской экономики российским фирмам;
- доход от иностранного туризма России;
- уменьшение золотовалютных резервов в Российской Федерации.

8 Вставьте пропущенное слово.

_____ международная инвестиционная позиция определяется путем уменьшения совокупных активов на совокупные пассивы.

9 Вставьте пропущенное слово.

Валовой внешний долг на отчетную дату представляет собой _____ сумму текущих безусловных обязательств резидентов перед нерезидентами, которая требует выплаты (выплат) процентов и/или основного долга в будущем.

10 Вставьте пропущенное слово.

Общее сальдо счета текущих операций и капитальных операций платежного баланса равно _____

3 Лабораторная работа

3.1 Методические указания

Лабораторная работа позволяет провести анализ исходной информации с помощью статистических методов и приемов, дать оценку полученных результатов на основе различных методов статистического анализа.

Творческое отношение обучающихся к написанию лабораторной работы способствует, с одной стороны, закреплению и дальнейшему углублению знаний, полученных в период изучения данной дисциплины, а с другой, - приобретению практических навыков в области статистического анализа экономики финансового сектора.

В лабораторной работе студенты должны продемонстрировать не только знание теоретических основ учебной дисциплины, но и умение применять статистическую методологию к изучению и анализу конкретных данных, формулировать и аргументировать выводы и рекомендации. При подготовке лабораторной работы необходимо использовать научную статистическую литературу, статистические бюллетени, справочники, сборники (отечественные, зарубежные и международные), официально публикуемые данные Минфина, Банка России, Московской биржи.

Выполнение лабораторной работы предполагает использование знаний, полученных при изучении не только экономики и статистики финансового сектора, но и других дисциплин (макροэкономики, анализа временных рядов, эконометрики, пакетов прикладных программ в статистике и др.). Подготовка лабораторной работы не только закрепляет и развивает теоретические и специальные знания студента в области изучаемой дисциплины, но инициирует их использование на завершающей стадии подготовки магистра по соответствующему направлению - написании выпускной квалификационной работы. Лабораторная работа представляет собой самостоятельное, хотя и небольшое по объему, исследование, которое демонстрирует умения обучающегося обобщать полученные знания, проводить

самостоятельные статистические расчеты с использованием пакетов прикладных программ. Задания к лабораторным работам могут быть изменены в ходе актуализации официально публикуемой статистической информации.

3.2 Варианты лабораторных работ

Лабораторная работа № 1. Сектор финансовых корпораций в системе национального счетоводства

Вариант 1



По имеющимся данным проанализируйте динамику индексации трудовых пенсий и пенсий по государственному пенсионному обеспечению Пенсионного фонда РФ.

Рассчитайте абсолютные, относительные и средние показатели динамики. Выявите наличие/отсутствие тенденций в анализируемых временных рядах. Проведите моделирование тенденций, оцените значимость и адекватность полученных моделей. Оцените коэффициенты опережения по видам пенсий.

Проведите сравнительный анализ полученных характеристик.

Вариант 2

По имеющимся данным проанализируйте показатели доходов и расходов бюджета федерального фонда обязательного медицинского страхования РФ в динамике. Оцените показатели расходов на душу населения при условии, что в 2014 г. среднегодовая численность населения РФ составляла 143,7 млн. чел., а в 2015 г. - 146,3 млн. чел. Проведите сравнительный анализ полученных расчетов.

Наименование показателя	Утверждено (млн. р.)	Исполнено за 2014 год (млн. р.)	Утверждено (млн. р.)	Исполнено за 2015 год (млн. р.)
Общий объем доходов бюджета ФОМС	1 240 116,1	1 250 545,1	1619774,0	1573543,4
в том числе за счет межбюджетных трансфертов, получаемых из федерального бюджета	28 550,0	28 550,0	23860,0	23860,0
Общий объем расходов бюджета ФОМС	1 240 116,1	1 268 657,8	1662786,2	1638814,6
в том числе межбюджетные трансферты, передаваемые бюджету Фонда социального страхования Российской Федерации	19 030,0	17 981,8	19030,0	18367,6
Объем дефицита бюджета ФОМС	0,0	18 112,7	43012,2	65271,2

Вариант 3

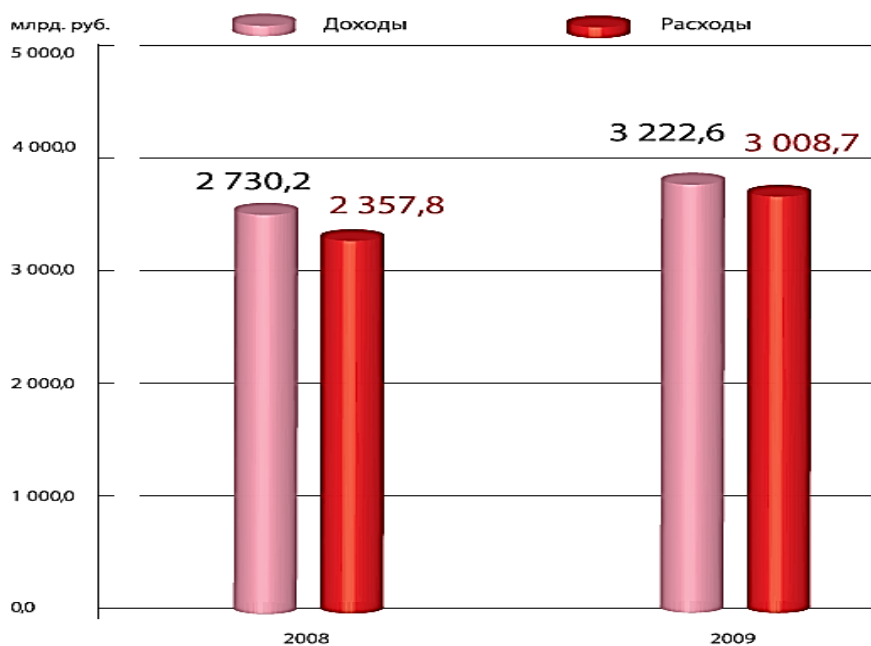
По имеющимся данным проанализируйте динамику доходов и расходов Пенсионного фонда России.

Рассчитайте абсолютные, относительные и средние показатели динамики, выявите наличие/отсутствие тенденций в анализируемых временных рядах.

Проведите моделирование тенденций, оцените значимость и адекватность полученных моделей.

Оцените коэффициенты опережения по доходам и расходам.

Проведите сравнительный анализ полученных характеристик.



Вариант 4

По имеющимся данным проведите статистический анализ динамики ключевой процентной ставки ЦБ, рассчитав абсолютные, относительные и средние показатели динамики.

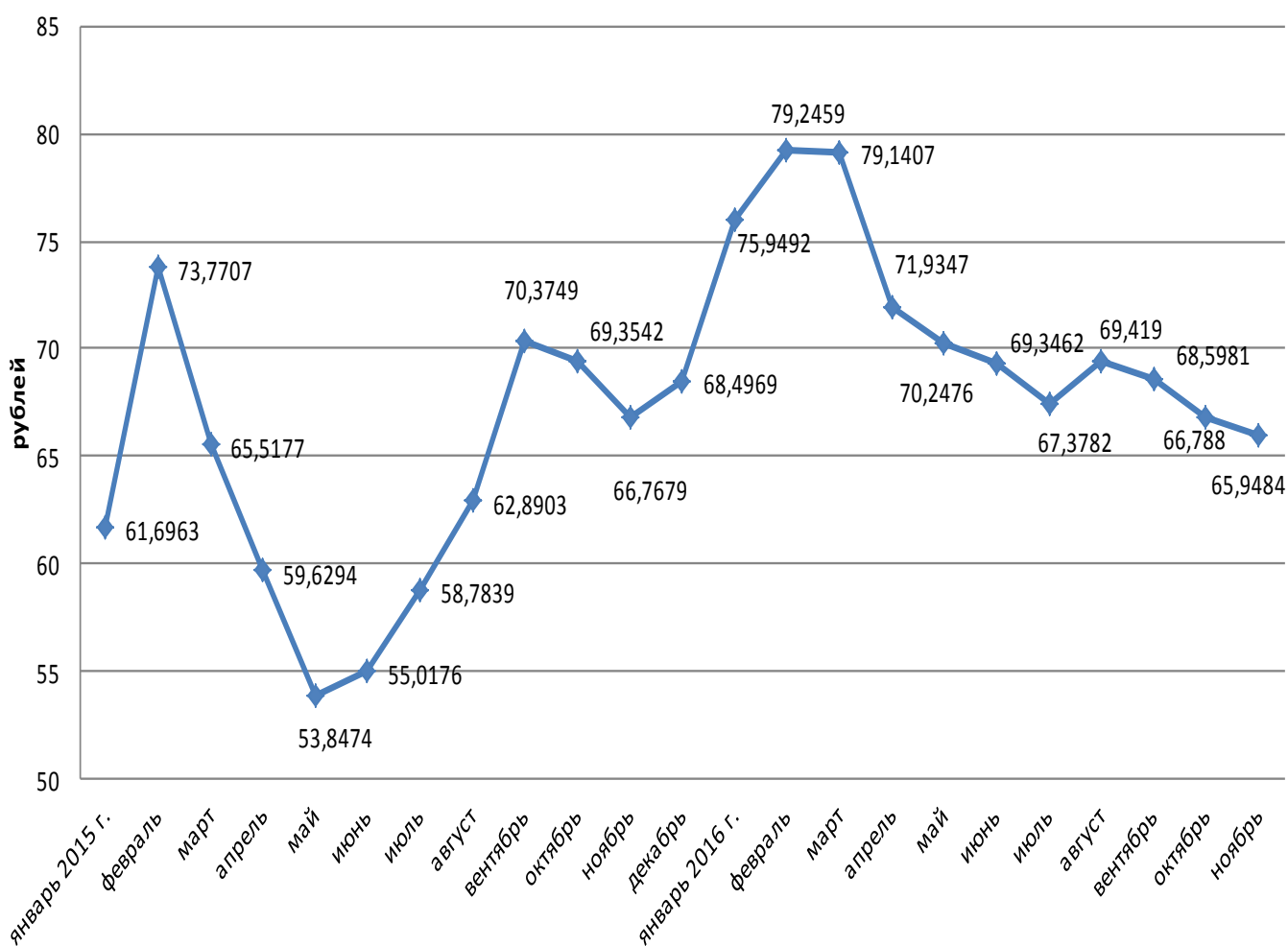
Отразите на графиках исходный ряд и относительные показатели динамики.

По полученным расчетам сделайте выводы.

Период действия	Ключевая ставка, %	Границы коридора процентных ставок, %
с 19 сентября 2016 г. - по 16 декабря 2016 г.	10,00	10,25 - 9,00
с 14 июня 2016 г. - по 18 сентября 2016 г.	10,50	11,50 - 9,50
с 03 августа 2015 г. - по 13 июля 2016 г.	11,00	12,00 - 10,00
с 16 июня 2015 г. - по 02 августа 2015 г.	11,50	12,50 - 10,50
с 05 мая 2015 г. - 15 июня 2015 г.	12,50	13,50 - 11,50
с 16 марта 2015 г. по 04 мая 2015 г.	14,00	15,00 - 13,00
с 02 февраля 2015 г. по 15 марта 2015 г.	15,00	16,00 - 14,00
с 16 декабря 2014 г. по 01 февраля 2015 г.	17,00	18,00 - 16,00
с 12 декабря 2014 г. по 15 декабря 2014 г.	10,50	11,50 - 9,50
с 05 ноября 2014 г. по 11 декабря 2014 г.	9,50	10,50 - 8,50
с 28 июля 2014 г. по 04 ноября 2014 г.	8,00	9,00 - 7,00
с 28 апреля 2014 г. по 27 июля 2014 г.	7,50	8,50 - 6,50
с 03 марта 2014 г. по 27 апреля 2014 г.	7,00	8,00 - 6,00
с 13 сентября 2013 г. по 02 марта 2014 г.	5,50	6,50 - 4,50

Вариант 5

Стоимость бивалютной корзины на начало месяца, р.



Примечание: Бивалютная корзина — корзина из доллара США и евро. Рублевая стоимость бивалютной корзины с февраля 2005 г. является операционным ориентиром курсовой политики Банка России. В настоящее время она рассчитывается как сумма 55 центов доллара США и 45 евроцентов в рублях. Приведены значения, рассчитанные по официальным курсам Банка России.

По имеющимся данным проанализируйте динамику стоимости бивалютной корзины. Рассчитайте абсолютные, относительные и средние показатели динамики.

Выявите наличие/отсутствие тенденции в анализируемом временном ряду.

Проведите моделирование тенденции различными способами, оцените значимость и адекватность полученных моделей.

Лабораторная работа № 2. Основные характеристики финансовых активов и других финансовых инструментов

Вариант 1

По имеющимся данным проанализируйте динамику объема выданных кредитов населению Оренбургской области. Рассчитайте абсолютные, относительные и средние показатели динамики. Выявите наличие/отсутствие тенденции в анализируемом временном ряду. Проведите моделирование сезонности, тенденции различными способами, оцените значимость и адекватность полученных моделей.

месяц	млн. р.	месяц	млн. р.	месяц	млн. р.
I 2010 г.	1144	IV 2012 г.	7 913	VII 2014 г.	10 254
II	4 093	V	8 469	VIII	9 070
III	4 416	VI	7 826	IX	9 053
IV	4 290	VII	8 121	X	9 206
V	4 151	VIII	8 600	XI	8 104
VI	4 699	IX	7 660	XII	9 840
VII	4 883	X	8 466	I 2015 г.	3 672
VIII	4 892	XI	8 477	II	3 848
IX	4 817	XII	9 312	III	4 452
X	4 694	I 2013 г.	6 426	IV	5 277
XI	4 902	II	7 644	V	5 148
XII	5 817	III	8 807	VI	6 289
I 2011 г.	3 521	IV	10 892	VII	6 579
II	4 421	V	9 605	VIII	6 207
III	5 346	VI	9 563	IX	6 326
IV	5 178	VII	11 207	X	5 627
V	5 131	VIII	10 701	XI	5 813
VI	5 447	IX	8 893	XII	7 574
VII	5 244	X	9 230	I 2016 г.	4 264
VIII	6 451	XI	9 421	II	5 765
IX	6 111	XII	11 114	III	6 108
X	6 105	I 2014 г.	6 151	IV	6 720
XI	6 575	II	7 494	V	6 338
XII	7 891	III	8 634	VI	7 255
I 2012 г.	4 861	IV	9 717	VII	6 612
II	6 419	V	9 253	VIII	7 829
III	7 354	VI	9 067		

Вариант 2

По имеющимся данным Сбербанка России проанализируйте динамику нормативов ликвидности Сбербанка России.

Выявите наличие/отсутствие тенденции в анализируемых временных рядах.

Проведите моделирование тенденции методом аналитического выравнивания, оцените значимость и адекватность полученных моделей.

Норматив ликвидности	В среднем за год									
	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014
Н2	55,6	53,3	45,1	53,5	82,5	80,6	50,8	61,4	53,6	74,3
Н3	63,1	65,7	54,0	70,5	114,4	103,0	72,9	74,3	58,5	66,4
Н4	91,8	101,9	101,9	71,4	73,8	78,0	87,3	99,8	102,5	111,2

Вариант 3

По имеющимся данным проанализируйте структуру объема выпущенных на внутреннем рынке РФ долговых ценных бумаг (млн. р.) и ее изменение.

По строке «Итого» рассчитайте абсолютные, относительные и средние показатели динамики.

Выявите наличие/отсутствие тенденции в анализируемом временном ряду.

Проведите моделирование тенденции методом аналитического выравнивания, оцените значимость и адекватность полученных моделей.

	01.10.2013	01.01.2014	01.04.2014	01.07.2014	01.10.2014	01.01.2015	01.04.2015
Итого	9 136 412	9 617 842	9 810 592	9 891 561	10 166 066	11 973 449	12 401 731
Кредитные организации	1 307 837	1 354 406	1 327 285	1 359 623	1 410 657	1 503 618	1 517 246
Страховщики	18 000	18 000	18 000	18 000	18 000	13 000	13 000
Другие финансовые организации	1 111 747	1 149 405	1 316 877	1 354 344	1 545 508	1 569 006	1 707 104
Органы государственного управления	4 569 162	4 859 751	4 857 140	4 896 539	4 892 619	5 892 743	5 791 168
Нефинансовые организации	2 041 866	2 133 480	2 188 490	2 161 255	2 197 482	2 889 282	3 267 413
Нерезиденты	87 800	102 800	102 800	101 800	101 800	105 800	105 800
	01.07.2015	01.10.2015	01.01.2016	01.04.2016	01.07.2016	01.10.2016	
Итого	12 712 740	12 887 010	13 271 590	13 305 563	13 829 443	13 970 396	
Кредитные организации	1 566 782	1 545 175	1 587 686	1 492 079	1 526 008	1 461 023	
Страховщики	13 000	13 000	13 000	13 000	13 000	13 000	
Другие финансовые организации	1 744 773	1 845 905	1 893 206	1 925 669	2 026 648	2 040 302	
Органы государственного управления	5 864 372	5 829 353	6 012 760	6 117 163	6 258 021	6 272 802	
Нефинансовые организации	3 415 013	3 544 777	3 651 138	3 641 852	3 890 966	4 068 469	
Нерезиденты	108 800	108 800	113 800	115 800	114 800	114 800	

Вариант 4

Необходимо сгладить временной ряд и спрогнозировать на следующий день значения котировок акций использованием различных статистических методов прогнозирования для ОАО «Сбербанк России».

Представьте графически исходные и выравненные уровни ряда.

Оцените значимость и адекватность полученных моделей.

Данные для анализа представлены на сайте ОАО «Московская биржа» - <http://rts.micex.ru/>. Период сглаживания - крайние полгода, предшествующие выполнению лабораторной работы.

Вариант 5

По имеющимся данным об индексе кредитного доверия (п.) и среднем обменном курсе доллара (р.) проведите моделирование регрессии курса на ИКД, включив дополнительно фактор времени. Отрадите на графике тенденции обоих показателей. Оцените значимость и адекватность полученных моделей.

Постройте варианты различные прогноза ИКД.

Период	Индекс кредитного доверия, п.	Средний обменный курс ЦБ, р.
1кв.2012	38	30,1519
2кв.2012	34	31,0579
3кв.2012	34	31,99987
4кв.2012	32	31,08393
1кв.2013	37	30,39683
2кв.2013	34	31,6543
3кв.2013	35	32,78913
4кв.2013	34	32,55797
1кв.2014	40	35,07567
2кв.2014	40	34,98363
3кв.2014	34	36,21187
4кв.2014	27	47,59553
1кв.2015	20	63,3448
2кв.2015	21	52,7119
3кв.2015	21	63,12853
4кв.2015	21	65,99333
1кв.2016	18	75,22707
2кв.2016	19	65,91353

Лабораторная работа № 3. Статистический учет производных финансовых инструментов

Вариант 1

Охарактеризуйте понятие «валютного свопа» и проанализируйте ежегодную динамику задолженности кредитных организаций перед Банком России по сделкам «валютный своп» за последние 10 лет.

Представьте данные и результаты расчетов в виде таблиц и диаграмм.

Рассчитайте базисные, цепные и средние показатели динамики.

Данные для анализа в ежемесячной динамике представлены на сайте Центробанка https://www.cbr.ru/hd_base/Default.aspx?Prtid=swapdaytotal.

Вариант 2

Охарактеризуйте понятия «форвардный контракт», «валютный спот». Проведите статистический анализ ежемесячной динамики объема и структуры откры-

тых сделок с валютными деривативами (USD) за последние три года. Представьте данные и результаты расчетов в виде таблиц и диаграмм.

Рассчитайте базисные, цепные и средние показатели динамики.

Данные для анализа в ежедневной динамике представлены на сайте Центробанка <https://www.cbr.ru/statistics/?PrtId=finr>.

Вариант 3

Охарактеризуйте понятия «форвардный контракт», «валютный спот». Проведите статистический анализ ежемесячной динамики объема и структуры открытых сделок с данными валютными деривативами (EUR) за последние три года. Представьте данные и результаты расчетов в виде таблиц и диаграмм. Рассчитайте базисные, цепные и средние показатели динамики.

Данные для анализа в ежедневной динамике представлены на сайте Центробанка <https://www.cbr.ru/statistics/?PrtId=finr>.

Вариант 4

Охарактеризуйте понятие «опцион». Проведите статистический анализ ежемесячной динамики объема и структуры открытых сделок по покупке опционов (EUR) за последние три года. Представьте данные и результаты расчетов в виде таблиц и диаграмм. Рассчитайте базисные, цепные и средние показатели динамики.

Данные для анализа в ежедневной динамике представлены на сайте Центробанка <https://www.cbr.ru/statistics/?PrtId=finr>.

Вариант 5

Охарактеризуйте понятие «опцион». Проведите статистический анализ ежемесячной динамики объема и структуры открытых сделок по продаже опционов (USD) за последние три года. Представьте данные и результаты расчетов в виде таблиц и диаграмм. Рассчитайте базисные, цепные и средние показатели динамики.

Данные для анализа в ежедневной динамике представлены на сайте Центробанка <https://www.cbr.ru/statistics/?PrtId=finr>.

Лабораторная работа № 4. Статистические характеристики финансового рынка.

Вариант 1

В поквартальной динамике сопоставьте курсы валют доллар США и евро, определив базисные, цепные и средние показатели динамики.

Рассчитайте коэффициенты опережения. Проведите сравнительный анализ средних показателей динамики.

База данных по курсам валют представлена на сайте Центробанка https://www.cbr.ru/currency_base/. В поквартальной динамике - <http://www.cbr.ru/statistics/?PrtId=svs>.

Вариант 2

Проведите статистический анализ ежемесячной динамики курса доллара США.

Выявите наличие/отсутствие сезонности. Оцените тенденцию ряда. Проведите эконометрическое моделирование и прогнозирование ряда, оценив значимость и адекватность построенных моделей.

База данных по курсам валют представлена на сайте Центробанка https://www.cbr.ru/currency_base/.

Вариант 3

Проведите статистический анализ динамики средневзвешенной цены акций ОАО Газпром в помесечной динамике за последние три года. Оцените тенденцию ряда. Проведите эконометрическое моделирование и прогнозирование ряда, оценив значимость и адекватность построенных моделей. Исходные данные для анализа в ежедневной динамике отражены на сайте Московской биржи <http://moex.com/>.

Вариант 4

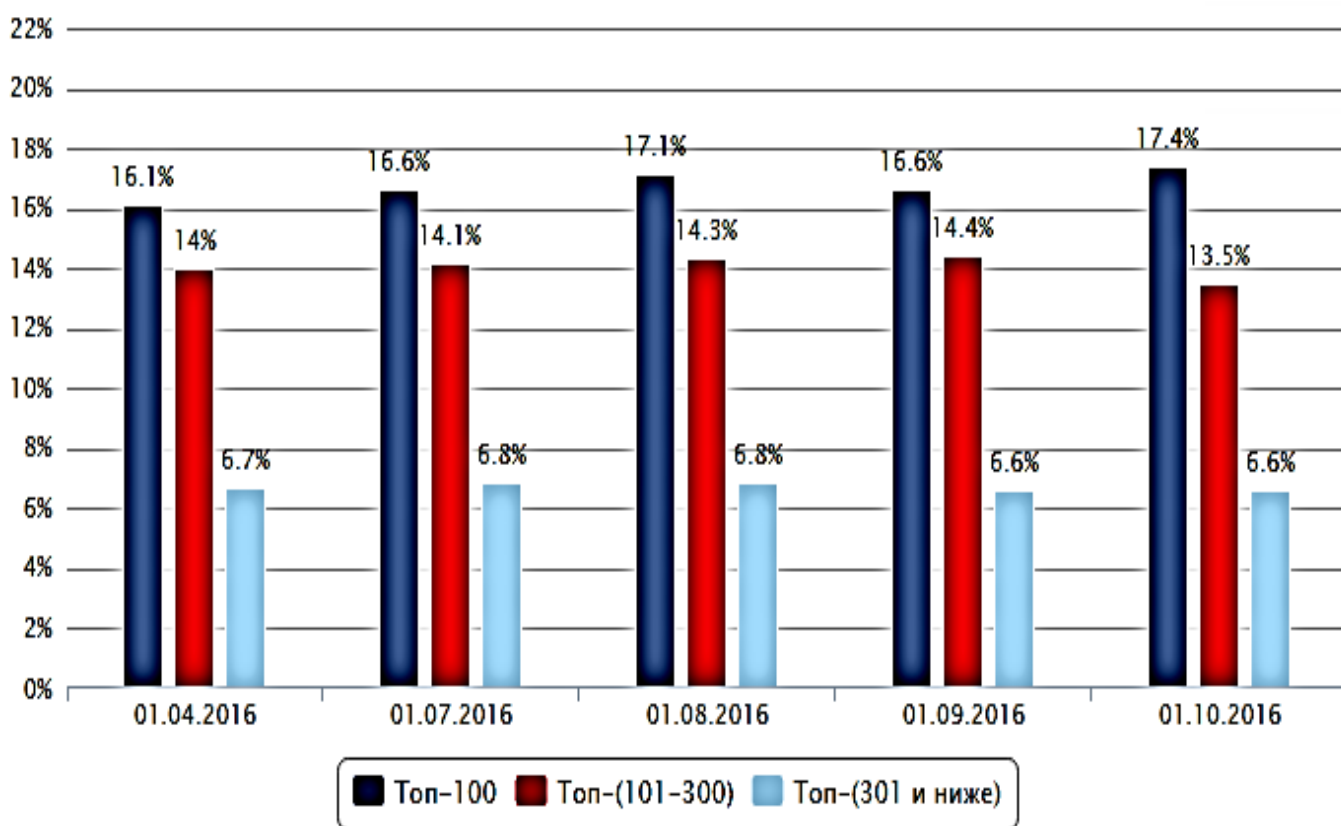
Проведите статистический анализ динамики средневзвешенной цены акций «Роснефть» в помесечной динамике за последние три года. Оцените тенденцию ряда. Проведите эконометрическое моделирование и прогнозирование ряда, оценив значимость и адекватность построенных моделей.

Исходные данные для анализа в ежедневной динамике отражены на сайте Московской биржи <http://moex.com/> и на сайте «Роснефть» <https://www.rosneft.ru/Investors/instruments/shareprice/>.

Вариант 5

По представленным данным Эксперт РА проведите структурно-динамический анализ доли ценных бумаг в активах российских банков.

По полученным расчетам проведите сравнительный анализ по разным категориям банков (топ-100, топ- (101-300), топ-(301 и ниже).



4 Расчетно-графическая (контрольная) работа

4.1 Методические указания

Цель проведения контрольной работы - проверить умение студентов ориентироваться в изученном теоретическом и практическом материале, анализировать и синтезировать его, грамотно излагать свои мысли и аргументировать свою позицию.

Работа включает в себя задания реконструктивного и творческого уровней, позволяя оценить и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; умения интегрировать знания различных областей, аргументировать свою точку зрения.

Для всестороннего освещения вопроса контрольной работы и правильного выполнения комплексного задания от каждого обучающегося требуются не только теоретические знания, но и умение использовать изученные статистические приемы и методы. Расчетно-графическая (контрольная) работа включает теоретический вопрос по дисциплине и выполнение комплексного задания с использованием официально публикуемой статистической информации.

Для получения положительной оценки необходимо, чтобы каждый обучающийся систематически занимался и своевременно выполнял домашние задания.

При оформлении контрольной работы следует руководствоваться положениями стандарта организации СТО 02069024. 101-2015 «РАБОТЫ СТУДЕНЧЕСКИЕ. Общие требования и правила оформления».

Расчетно-графическая (контрольная) работа состоит из 5-ти вариантов. Номер варианта контрольной работы соответствует последней цифре в зачетной книжке студента (таблица 4.1):

Таблица 4.1

Последняя цифра в зачетной книжке	№ варианта
0,1	1
2,3	2
4,5	3
6,7	4
8,9	5

Выполненная контрольная работа должна соответствовать следующим требованиям:

1) номер варианта указывается в самом начале работы. Замена заданий не допускается. Страницы должны иметь сквозную нумерацию и поля для замечаний рецензента. Записи должны быть сделаны аккуратно и разборчиво, допускаются только общепринятые сокращения;

2) перед решением задачи приводится ее условие;

3) расчеты должны быть представлены в развернутом виде, с необходимыми формулами, пояснениями, выводами; с соблюдением достаточной точности вычислений (до 0,1; 0,01; 0,001 в зависимости от показателей). В пояснениях и выводах необходимо показать, что именно и как характеризует исчисленный показатель. В процессе выполнения задания необходимо проверять полученные результаты, пользуясь взаимосвязью показателей;

4) таблицы и графики строятся в соответствии с правилами, принятыми в статистике;

5) в конце работы следует указать список использованной литературы, автора, название литературного источника, место и год издания, поставить подпись и дату выполнения работы;

6) контрольная работа должна быть представлена на рецензирование в установленные учебным планом сроки.

При удовлетворительном выполнении работа оценивается «допущен к собеседованию». Если работа не допущена к собеседованию, то студент обязан учесть все замечания и внести исправления в текст работы или выполнить ее заново и представить повторно на проверку.

4.2 Комплексные практические задания к расчетно-графической (контрольной) работе

Вариант 1

Теоретический вопрос.

Другие депозитные корпорации. Другие финансовые корпорации. Другие финансовые посредники.

Задача.

Составьте статистические таблицы по: доходности казначейских обязательств; ставкам денежного рынка; ставкам привлеченных депозитов; ставкам предоставленных кредитов - по трем странам мира за три квартала (помесячно) последнего опубликованного года.

Проанализируйте динамику ставок и сделайте выводы.

Проведите моделирование и прогнозирование имеющихся данных, оценив значимость и адекватность полученных моделей.

Вариант 2

Теоретический вопрос.

Производные финансовые инструменты. Другая дебиторская/кредиторская задолженность. Другие финансовые инструменты.

Задача.

Составьте таблицу не менее чем за 10 лет, предшествующих настоящему году, отразив в ней золотовалютные резервы России, включающие валютные резервы и золото.

Составьте таблицу валютных резервов России с разбивкой на иностранную валюту, СДР, резервную позицию в МВФ.

Определите показатели динамики и структуры анализируемых величин. Проведите моделирование и прогнозирование имеющихся данных, оценив значимость и адекватность полученных моделей.

Определите коэффициент покрытия золотовалютными резервами широкой денежной базы.

Вариант 3

Теоретический вопрос.

Платежи при заключении и исполнении контракта. Гарантийные депозиты. Учет некоторых производных финансовых инструментов.

Задача.

Используя поквартальные данные за 3 последних опубликованных года по Международной инвестиционной позиции банковской системы РФ установите, какие классификационные группы активов и обязательств отражены в подлежащем таблиц.

Как отражает состояние внешних активов/обязательств российских резидентов сказуемое таблиц?

Определите и проанализируйте общую сумму чистых изменений в результате: операций, переоценки, прочих изменений.

Проанализируйте, какие структурные изменения произошли в обязательствах и активах на конец периода по сравнению с его началом.

Проведите моделирование и прогнозирование имеющихся данных, оценив значимость и адекватность полученных моделей.

Вариант 4

Теоретический вопрос.

Методы статистического анализа доходности ценных бумаг. Статистический анализ финансовых вложений. Банковская статистика международных финансовых рынков.

Задача.

Проанализируйте счет текущих операций не менее чем за 10 предыдущих лет на основе показателей динамики, структуры, относительных величин интенсивности.

Определите, как ежегодно изменяется величина экспорта и импорта услуг.

Проведите моделирование и прогнозирование имеющихся данных, оценив значимость и адекватность полученных моделей.

Сделайте выводы.

Вариант 5

Теоретический вопрос.

Источники информации для составления Платежного баланса. Международная инвестиционная позиция и международные резервы. Статистика государственного внешнего долга.

Задача.

Используя официальные статистические данные о внешней торговле России определите структуру экспорта и импорта за 2000 г. и текущий год.

Оцените динамику этих показателей с помощью абсолютных, относительных и средних показателей.

Проведите моделирование и прогнозирование имеющихся данных, оценив значимость и адекватность полученных моделей.

Сделайте выводы.

5 Литература, рекомендуемая для изучения дисциплины

1 Статистика: учеб. для вузов / под ред. И. И. Елисеевой; Санкт-Петербург. гос. ун-т экономики и финансов. - Москва: Юрайт, 2011. - 566 с. : ил. - (Основы наук). - Библиогр.: с. 564-565. - ISBN 978-5-9916-1053-7. - ISBN 978-5-9692-1071-4.

2 Эконометрика [Электронный ресурс]: учеб. для вузов / под ред. В. Н. Афанасьева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т" ; [В. Н. Афанасьев и др.]. - Электрон. текстовые дан. (1 файл: Kb). - Оренбург: ОГУ, 2012. - AdobeAcrobatReader 5.0.

3 Афанасьев, В.Н. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебник / В.Н. Афанасьев, М.М. Юзбашев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Финансы и статистика, 2012. - 320 с. - ISBN 978-5-279-03400-0; [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=215316> .

4 Афанасьев, В.Н. Анализ временных рядов и прогнозирование: учебник / В.Н. Афанасьев, М.М. Юзбашев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Финансы и статистика, 2012. - 320 с. - ISBN 978-5-279-03400-0.

5 Статистика финансов: учебник для вузов / под ред. В. Н. Салина.- 2-е изд. - Москва: Финансы и статистика, 2002. - 816 с. : табл. - ISBN 5-279-02483-X.

6 Образцова, О. И. Система национальных счетов : учебник для студентов вузов / О. И. Образцова, О. В. Копейкина. - Москва: ИД ГУ ВШЭ, 2008. - 460 с. : табл. - (Учебники Высшей школы экономики). - Библиогр.: с. 456-460. - ISBN 978-5-7598-0452-9.

7 Бурцева, С.А. Статистика финансов: учеб. для вузов / С.А. Бурцева. - Финансы и статистика, 2004. - [Электронный ресурс]. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php> .

8 Национальное счетоводство: учеб. для вузов / под ред. Б. И. Башкатова.- 3-е изд. - Москва: Финансы и статистика, 2005. - 608 с.: ил. - Предм. указ.: с. 606-607. - ISBN 5-279-02990-4.

9 Социально-экономическая статистика: учебник / под ред. М. Р. Ефимовой.- 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юрайт, 2011. - 592 с. - (Основы наук). - Библиогр.: с. 582-584. - Прил.: с. 586-591. - ISBN 978-5-9916-1066-7. - ISBN 978-5-9692-1075-2.

10 Практикум по финансовой статистике : учеб. пособие / Т.В. Тимофеева, А.А. Снатенков. – Москва: Финансы и статистика; ИНФРА-М, 2009. – 320 с.: ил. - ISBN 978-5-279-03359-1 (Финансы и статистика), ISBN 978-5-16-003662-5 (ИНФРА-М).

11 Эконометрика: учеб. для вузов / под ред. И. И. Елисейевой.- 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Финансы и статистика, 2008. - 576 с.: ил. - Библиогр.: с. 556-557. - Прил.: с. 558- 570. - Предм. указ.: с. 571. - ISBN 978-5-279-02786-6.

12 Практикум по эконометрике: учеб.пособие для экономических вузов / под ред. И. И. Елисейевой.- 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Финансы и статистика, 2008. - 344 с. : ил + 1 электрон. опт. диск (CD-ROM - 2007) . - Прилагается компакт-диск к каждому экз. - Прил. : с. 332-342. - ISBN 978-5-279-02785-9.

13 Фондовый рынок: учеб. пособие для вузов / Н. И. Берзон, Е. А. Буянова, М. А. Кожевников; под ред. Н. И. Берзона. - Москва: Вита-Пресс, 1998. - 400 с.: ил. - (Программа "Высшее образование") - ISBN 5-7755-0057-1.

14 Буренин, А. Н. Рынок ценных бумаг и производных финансовых инструментов: учеб. пособие для вузов / А. Н. Буренин. - Москва: 1 Федер. Книготорговая Компания, 1998. - 352 с. - ISBN 5-7814-0070-2.

15 Минашкин, В.Г. Статистика фондового рынка. Учебно-методический комплекс / В.Г. Минашкин - Евразийский открытый институт, 2008. - [Электронный ресурс]. - Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red .

16 Романов В. П. Информационные технологии моделирования финансовых рынков / Романов В. П., Бадрина М. В. –Москва: Финансы и статистика, 2010.

- [Электронный ресурс]. - Режим доступа:
http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red .

17 Пекарская, Н. Э. Финансово-банковская статистика: учеб.-практ. пособие / Н. Э. Пекарская, А. Э. Ярмолинская; М-во образования республики Беларусь, УО "Белорус. гос. экон. ун-т". - Минск: БГЭУ, 2006. - 73 с. - (Система дистанционного обучения). - Библиогр.: с. 74. - ISBN 985-484-270-3.

18 Финансовая статистика: учеб. пособие / Т.В. Тимофеева, А.А. Снатенков, Е.Р. Мендыбаева; под ред. Т.В. Тимофеевой. – Москва: Финансы и статистика, 2006. – 480 с. – ISBN 5,279-03135-6.

19 Экономическая статистика: учеб. для вузов / под ред. Ю. Н. Иванова.- 2-е изд., доп. - Москва: ИНФРА-М, 2001. - 480 с. - (Высшее образование). - Прил.: с. 461-466. - Слов.осн. терминов: с. 467-474. - ISBN 5-16-000084-4.

20 Суэтин, А. А. Международные валютно-финансовые отношения: учеб.для вузов / А. А. Суэтин.- 2-е изд., испр. и доп. - Москва: КноРус, 2005. - 288 с. - ISBN 5-85971-116-6.

21 Суэтин, А. А.Международные валютно-финансовые отношения [Электронный ресурс] : электрон. учебник / А. А. Суэтин. - Электрон. дан. - Москва: КноРус, 2010. - 1 электрон.опт. диск (CD-ROM). - Минимальные систем.требования: Windows 2000 XP, оперативная память 64Мб, жесткий диск 40Мб, видеокарта 8Мб памяти, CD привод, звуковая карта.

22 Селеванова, Т. С. Ценные бумаги: теория, задачи с решениями, учебные ситуации, тесты / Т. С. Селеванова . - Москва: Дашков и К, 2008. - 384 с. - Библиогр.: с. 378. - ISBN 978-5-91131-724-9.

23 Вопросы статистики: журнал. - М.: ИИЦ «Статистика России».

24 Вопросы экономики: журнал. – М.: НП «Редакция журнала «Вопросы экономики».

25 Экономический журнал ВШЭ: журнал. – М.: Издательский дом Государственного Университета - Высшей Школы Экономики.

26 Российский экономический журнал: журнал. – М.: Изд-во «Финансы и статистика».

- 27 Банковские услуги: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
- 28 Банковское дело: журнал. - М.: Капитал-инфо.
- 29 Бюллетень банковской статистики. Региональное приложение: рекламный журнал. - М.: Центральный банк Российской Федерации.
- 30 Финансы и кредит: журнал. - М.: ООО "Издательский дом Финансы и кредит".
- 31 Финансы и бизнес: журнал. – М.: Изд-во «Проспект».
- 32 Экономический анализ: теория и практика: журнал. – М.: Издательский дом «Финансы и кредит».
- 33 Бухгалтерия и банки: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
- 34 Рынок ценных бумаг: журнал. - М.: Агенство "Роспечать".
- 35 Федеральная служба государственной статистики: - [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.gks.ru>.
- 36 Территориальный орган Федеральной службы государственной статистики по Оренбургской области: [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.orenstat.ru>.
- 37 Высшая школа экономики: [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.hse.ru>
- 38 Федеральная служба по финансовым рынкам [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.fcsм.ru/> .
- 39 Международная федерация фондовых бирж: [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.fibv.com/>
- 40 Информационное агентство Финмаркет: [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.finmarket.ru/>
- 41 Экономическое обозрение: [Официальный сайт]. – Режим доступа: <http://www.review.uz/ru> .