РЕПУБЛИКА БЪЛГАРИЯ

**СТОПАНСКА АКАДЕМИЯ “Д. А. ЦЕНОВ” – СВИЩОВ**

|  |  |
| --- | --- |
| Факултет“СТОПАНСКА ОТЧЕТНОСТ” | Катедра  “СТАТИСТИКА И ПРИЛОЖНА МАТЕМАТИКА” |
|  |  |
| **Утвърждавам:** |  |
| Декан: …...…………….............................  (доц. д-р Маргарита Шопова) | Приета от ФС, Протокол № 6 от 26.11.2024 г. Приета от КС, Протокол № 5 от 19.11.2024 г. |
| **УЧЕБНА ПРОГРАМА**  **на** | |
| Учебна дисциплина“Финансова статистика” | |
| **Код на дисциплината: ФСО-КСПМ-Б-332**  **Брой кредити по учебен план: (5)** | |
| Образователно-квалификационна степен: БАКАЛАВЪР | Код на документа:УД/УПР-ФСО-КСПМ-Б-332 |
| Форма на обучение: РЕДОВНА/ЗАДОЧНА/ДИСТАНЦИОННА Език: БЪЛГАРСКИ | Версия:v.02/2024 |

**І. ОРГАНИЗАЦИЯ НА ОБУЧЕНИЕТО**

**Часове учебна заетост (семестър с продължителност 14 седмици)**

***Таблица № 1***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Учебна заетост**  **/аудиторна и извънаудиторна/** | **Редовна форма на обучение** | **Задочна форма на обучение** | **Дистанционна форма на обучение** |
| **1. Аудиторна заетост (АЗ)** | **56** | **28** | **56** |
| 1.1. Лекции | 28 | 14 | 28 |
| 1.2. Семинарни занятия | 28 | 14 | 28 |
| **2. Извънаудиторна заетост (ИАЗ)** | **69** | **97** | **69** |
| 2.1.Самостоятелна работа | 35 | 49 | 35 |
| 2.2. Академични задания | 34 | 48 | 34 |
| 2.2.1. Курсови разработки и проекти | 20 | 34 | 20 |
| 2.2.2. Есета/доклади | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.3. Казуси и делови игри | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.4. Онлайн тестови и изпитни модули | 14 | 14 | 14 |
| **Всичко:** | **125** | **125** | **125** |

**Схема за формиране на крайната оценка по дисциплина**

***Таблица № 2***

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Критерий** | **Тежест на критерия** | | |
| **Редовна форма на обучение** | **Задочна форма на обучение** | **Дистанционна форма на обучение** |
| **1. Изпълнение на ангажименти през семестъра, в т.ч.:** | **60%** | **60%** | **60%** |
| * 1. Посещение на учебни занятия   *(% от комплексната оценка)* | 10% | 10% | 10% |
| 1.2. Семестриални контролни  *(% от комплексната оценка)* | 30% | 30% | 30% |
| 1.3. Академични задания  *(% от комплексната оценка)* | 20% | 20% | 20% |
| **2. Семестриален изпит**  *(% от комплексната оценка)*  *Форма на провеждане:*  *Поливариантни тестове.* | **40%** | **40%** | **40%** |
| **Общо за дисциплината** | **100%** | **100%** | **100%** |

**II. Анотация**

**2.1. Цел на курса**

Целта на учебната дисциплина “Финансова статистика” е да се дадат знания на студентите от специалност "Финанси", за да могат успешно да реализират възможностите, които предоставят статистическите методи за анализ във финансовата сфера. Основната задача на изучаването на дисциплината е да се развие у студентите способност за приложение на конкретните статистически методи, прийоми и техники при емпиричните изследвания в областта на финансите, банковото дело, инвестициите и пр.; да се изгради статистическо мислене, т.е. да се борави с категориите и основните статистически понятия при изучаване на масовите явления.

**2.2. Предварителни изисквания**

Изучаването на дисциплината се основава на придобитите общоикономически и специализирани знания по дисциплините: Финанси, Обща теория на статистиката, Инвестиции, Финансов анализ, Международни финанси, Пари и кредит и др. Учебният материал е структуриран по теми, които са основни методологически единици, като изложението се базира на последователно и методично изясняване на основните проблеми.

**2.3. Използвани методи на преподаване**

***2.3.1 Редовна и задочна форма***

В процеса на обучение се използват класически методи за преподаване на теоретични знания (лекции, дискусии, решаване на задачи и др.). Чрез подходящи примери, базирани на данни от статистическата практика, се демонстрира приложението на теоретично представените статистически методи за анализ, оценка и прогнозиране на показатели за дейността на банките, борсите, застрахователните дружества и др.

***2.3.2 Дистанционна форма***

Обучението на студентите се осъществява с помощта на online (синхронни и асинхронни) лекции, участие в консултации, участие във форумите и чат-групите, лични контакти по телефон или e-mail. С помощта на реални данни, набавени от различни информационни източници в интернет, се извършва апробиране на представените в дисциплината специфични статистически модели.

**2.4. Очаквани резултати**

След усвояване на знанията по дисциплината “Финансова статистика“ студентите ще могат успешно да участват в организирането и провеждането на емпирични изследвания в областта на финансите, да обработват и анализират резултати от проведени изследвания, както и умения да прилагат статистически методи за анализ, оценка и прогнозиране на системата от показатели, характеризиращи публичните финанси, банките, борсите и инвестициите и др. Придобитите знания и умения ще подпомогнат обучението на студентите по дисциплините, в които се използват статистически методи за анализ на данни за финансови показатели, но същевременно и допринасят за формирането на квалифицирани специалисти-икономисти в сферата на финансите.

**III. разпространение на дисциплината**

1. Дисциплина:Статистика на борсовите операции; Университет: УНСС - София.

2. Дисциплина:Финансова статистика; Университет: Икономически университет - Варна.

3. Дисциплина:Финансова иконометрия; Университет: Икономически университет - Варна.

4. Дисциплина: NUMERICAL AND STATISTICAL METHODS FOR FINANCE; Университет: University of Milano, Италия.

5. Дисциплина: EMPIRICAL METHODS IN FINANCE; Университет: Frankfurt School of Finance &Management, Германия.

6. Дисциплина: FINANCIAL ECONOMICS WITH ECONOMETRICS; Университет: University of Kent, Великобритания.

7. Дисциплина: STATISTCAL FINANCE; Университет: Waseda University, Япония.

8. Дисциплина: QUANTITATIVE METHODS IN FINANCE; Университет: USC University of Southern California, САЩ.

**IV. Учебно съдържание**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ТемИ** | **Редовна форма на обучение** | | **Задочна форма на обучение** | | **Дистанционна форма на обучение** | |
| **Л** | **У** | **Л** | **У** | **Л** | **У** |
| **Тема I. Въведение във финансовата статистика** | 2 | 2 | 1 | 1 | 2 | 2 |
| *1. Обект, предмет и метод на финансовата статистика. 2. Източници на информация за финансовата статистика. 3. Връзка на финансовата статистика с другите икономически дисциплини. 4. Финансовата статистика като теория и практическа дейност – исторически преглед. 5. Съвременна организация на финансовата статистика.* |
| **Тема II. Финансовите операции в системата на националните сметки** | 2 | 2 | 1 | 1 | 2 | 2 |
| *1. Същност на системата на националните сметки (СНС) – категории, определения и принципи на изграждане. 2. Основни класификации и видове сметки в СНС. 3. Същност на финансовата сметка. Основни финансови операции. 4. Статистически показатели за резултатите от икономическата дейност.* |
| **Тема III. Статистическо изучаване на консолидирания държавен бюджет** | 4 | 4 | 2 | 2 | 4 | 4 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване 2. Система от показатели за характеризиране на консолидирания държавен бюджет 3. Статистически методи за анализ на републиканския бюджет 4. Статистически методи за анализ на бюджетите на общините 5. Статистически методи за анализ на бюджетните трансфери.* |
| **Тема IV. Статистическо изучаване на държавния дълг** | 4 | 4 | 2 | 2 | 4 | 4 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Система от показатели за характеризиране на държавния дълг. 3. Статистически методи за анализ на външния дълг. 4. Статистическо методи за анализ на вътрешния дълг.* |
| **Тема V. Статистическо изучаване на паричното обръщение** | 2 | 2 | 1 | 1 | 2 | 2 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Система от показатели за характеризиране на паричното обръщение. 3. Статистически методи за анализ на обема и структурата на паричната маса. 4. Статистически методи за анализ и прогнозиране на паричното обръщение.* |
| **Тема VI. Статистическо изучаване на банковата дейност** | 4 | 4 | 2 | 2 | 4 | 4 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Система от показатели за характеризиране на кредитните операции. 3. Система от показатели за характеризиране на депозитите. 4. Статистически методи за анализ на банковата дейност.* |
| **Тема VII. Статистическо изучаване на застрахователната дейност** | 2 | 2 | 1 | 1 | 2 | 2 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Статистически методи за анализ на застрахователния състав. 3. Статистически методи за анализ на ощетимостта. 4. Статистически методи за анализ на застрахователните плащания.* |
| **Тема VIII. Статистическо изучаване на дейността на борсите** | 4 | 4 | 2 | 2 | 4 | 4 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Система от статистически показатели за дейността на фондовите борси. 3. Статистически методи за анализ на показателите за борсовата търговия.* |
| **Тема IX. Статистическо изучаване на инвестициите** | 4 | 4 | 2 | 2 | 4 | 4 |
| *1. Същност и информационно осигуряване на статистическото изучаване. 2. Система от показатели за характеризиране на инвестициите. 3. Статистически методи за анализ на чуждестранните преки инвестиции. 4. Статистически методи за анализ на разходите за придобиване на дълготрайни материални активи.* |
| **Общо:** | **28** | **28** | **14** | **14** | **28** | **28** |

**V. ИЗПОЛЗВАНИ УЧЕБНО-ТЕХНИЧЕСКИ СРЕДСТВА**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Наименование на**  **Учебно-техническото средство** | **Използвани учебно-технически средства по вид на занятията** | |
| **Лекции** | **Семинарни**  **занятия** |
| 1. Мултимедийни системи за презентиране | X | X |
| 2. Интернет | X | X |
| 3. Специализирани програмни продукти: |  |  |
| 3.1  MS Excel | X | X |

**VI. ПреПОРЪЧИТЕЛНИ МАТЕРИАЛИ И НОРМАТИВНИ ИЗТОЧНИЦИ**

**6.1. Основна литература**

|  |
| --- |
| 1. Ангелова, П., Славева, К. (2017). Финансова статистика - учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ “Ценов”. |
| 2. Учебен курс “Финансова статистика“ в Платформата за дистанционно и електронно обучение на СА “Д. А. Ценов“, https://dl.uni-svishtov.bg. |
| 3. Ангелова, П., Иванов, Л., Петков, П., Славева, К., Касабова, С., Шопова, М., Върбанов, Т. (2018). Основи на статистиката - учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ "Ценов" |
| 4. Петков, П. (2020) Иконометрия - учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ “Ценов”. |
| 5. Славева, К. (2020). Икономическа статистика - учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов. АИ "Ценов" |
| 6. Ангелова, П., Иванов, Л., Петков, П., Славева, К., Касабова, С., Върбанов, Т. (2017). Основи на статистиката,АИ "Ценов" Свищов. |
| 7. Петков, П., Иванов, Л. (2021). Иконометрични модели - учебно пособие за бакалавърско обучение. Свищов, АИ "Ценов"- |
| 8. Иванов, Л., Касабова, С., Шопова, М. (2020). Статистическо изследване и прогнозиране на развитието – учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ "Ценов“. |
| 9. Петков, П., Иванов, Л. (2017). Статистически и иконометричен софтуер – учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ “Ценов”. |
| 10. Ангелова, П. (2017). Основи на статистиката. Свищов, АИ “Ценов”. |
| 11. Петков, П. (2020). Иконометрия с Gretl. Свищов, АИ "Ценов ". |
| 12. Иванов, Л.,Касабова, С., Шопова, М. (2017). Статистическо изследване и прогнозиране на развитието, Свищов, АИ “Ценов”, 2017. |

**6.2. Допълнителна литература**

|  |
| --- |
| 1. Тримесечно издание „Икономически преглед“ |
| 2. Тримесечно издание „Банките в България“ |
| 3. Тримесечно издание „Пазар на държавни ценни книжа“ |
| 4. Месечно издание „Информационен бюлетин“ |
| 5. Икономически бюлетин на ЕЦБ |
| 6. Статистически годишник |
| 7. Статистически справочник |
| 8. Списание "Статистика" |
| 9. Списание "Финанси" |
| 10. Списание "Банки Инвестиции Пари" |
| 11. Месечен обзор на българската икономика |
| 12. Europe in Figures – Eurostat yearbook |
| 13. Box, G. E. P, G. M. Jenkins, G. C. Reinsel. (1994). Time Series Analysis. Forecasting and Control. 3rd edition. Prentice Hall. New Jersey. |
| 14. Teall, J. L., Hasan, I. (2002). Quantitative Methods for Finance and Investments. Iowa State Blackwell Publishing USA Press. |
| 15. Mills. T. C. (1999). The Econometric Modeling of Financial Time Series. 2nd edition. Cambridge University Press. Cambridge. |
| 16. Мейсън, А. (2000). Финансова математика и статистика. Международен банков институт, С. |
| 17. Славева, К. (2018). Методология и методика на емпиричните изследвания – модул „Статистика“. Електронно учебно пособие. Свищов. |
| 18. Салин, В. Н. и др. (2002). Статистика финансов. Москва, “Финансы и статистика”. |
| 19. Менгов, Г. (2010). Вземане на решения при риск и неопределеност. С. Издателска къща „Жанет45”. |
| 20. Матеев, М. (2013). Инвестиции и инвестиционен мениджмънт: теория и практика |
| 21. Блейк, К. (2009). Изкуството да вземаме решения. Как да управляваме в един несигурен свят.(превод от англ. език), С. Издателска къща „АМАТ-АХ”. |

**6.3. Нормативни документи**

|  |
| --- |
| 1. Закон за статистиката |
| 2. Стратегия за развитие на Националната статистическа система на Република България, 2013 - 2017 г. |
| 3. РЕГЛАМЕНТ (ЕО) № 223/2009 НА ЕВРОПЕЙСКИЯ ПАРЛАМЕНТ И НА СЪВЕТА от 11 март 2009 г. относно европейската статистика. Европейски съюз, http://eur-lex.europa.eu/ |
| 4. Кoдекс на Европейската статистическа практика |
| 5. Методология за разработване на национални финансови сметки за България ЗА БЪЛГАРИЯ |
| 6. Методология държавен дефицит/излишък по подсектори на "Държавно управление" и равнище на дълга |
| 7. Inventory of the methods, procedures and sources used for the compilation of deficit and debt data and the underlying government sector accounts according to ESA2010 |
| 8. Нефинансови сметки на сектор „Държавно управление” |
| 9. Специален стандарт за разпространение на данни Плюс |
| 10. Закон за пазарите на финансови инструменти |
| 11. Закон за кредитните институции. |

**6.4. Интернет ресурси**

|  |
| --- |
| 1. http://www.nsi.bg |
| 2. http://www.bnb.bg |
| 3. http://www.minfin.bg |
| 4. http://www.fsc.bg/bg/ |
| 5. http://www.bse-sofia.bg/ |
| 6. https://www.ecb.europa.eu/home/html/index.en.html |
| 7. http://www.imf.org/external/index.htm |
| 8. http://www.worldbank.org/ |
| 9. http://ec.europa.eu/eurostat |

Съставил/и/:

|  |
| --- |
| …………………………………  (доц. д-р Красимира Славева) |
| …………………………………  (гл. ас. д-р Тихомир Върбанов) |

Ръководител катедра:

|  |  |
| --- | --- |
| …………………………………  (доц. д-р Пламен Петков) |  |