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 № 7 от 16.12.2024 г.Приета от КС, Протокол № 6 от 09.12.2024 г. |
| **УЧЕБНА ПРОГРАМА****на** |
| Учебна дисциплина“Финансова статистика” |
| **Код на дисциплината: ФСО-КСПМ-М-306****Брой кредити по учебен план: (6)** |
| Образователно-квалификационна степен: МАГИСТЪР | Код на документа:УД/УПР-ФСО-КСПМ-М-306 |
| Форма на обучение: РЕДОВНА/ЗАДОЧНА/ДИСТАНЦИОННАЕзик: БЪЛГАРСКИ | Версия:v.03/2024 |

**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 | 42 | 21 | 42 |
| 1.2. Семинарни занятия | 14 | 7 | 14 |
| **2. Извънаудиторна заетост (ИАЗ)** | **94** | **122** | **94** |
| 2.1.Самостоятелна работа | 47 | 61 | 47 |
| 2.2. Академични задания | 47 | 61 | 47 |
| 2.2.1. Курсови разработки и проекти | 33 | 47 | 33 |
| 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:** | **150** | **150** | **150** |

**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 изпитни тестове и решаване на задачи.* | **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 магистърска програма “Приложна статистика”, за да могат успешно да реализират възможностите, които предоставят статистическите методи за анализ във финансовата сфера.

**2.2. Предварителни изисквания**

Изучаването на дисциплината се основава на придобитите общоикономически и специализирани знания в ОКС „бакалавър“ – Въведение в общата теория на статистиката, Икономическа статистика, Финанси, Пари и кредит, Инвестиции 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***

Лекции, решаване на практически задачи и дискусии.

***2.3.2 Дистанционна форма***

Обучението на студентите се осъществява с помощта на интернет базирани информационни технологии (платформа за дистанционно обучение, социални мрежи и сайтове за комуникация и обучение) с прилагане на иновативни синхронни и асинхронни методи на преподаване (интерактивно обучение, участие в консултации, участие във форуми и чат групи, лични контакти по телефон или електронна поща).

**2.4. Очаквани резултати**

В резултат на обучението по дисциплината студентите ще развият способности за приложение на конкретните статистически методи, прийоми и техники при емпиричните изследвания в областта на финансите, банковото дело, инвестициите и ще се изгради статистическо мислене и умения за боравене с категориите и основните статистически понятия при изучаване на масовите явления.

**III. разпространение на дисциплината**

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

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

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

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

**IV. Учебно съдържание**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **ТемИ** | **Редовна форма на обучение** | **Задочна форма на обучение** | **Дистанционна форма на обучение** |
| **Л** | **У** | **Л** | **У** | **Л** | **У** |
| **Тема І. Въведение във финансовата статистика** | 2 | 1 | 1 | 0 | 2 | 1 |
| *1. Обект, предмет и метод на финансовата статистика2. Източници на информация за финансовата статистика3. Връзка на финансовата статистика с другите икономически дисциплини4. Финансовата статистика като теория и практическа дейност – исторически преглед5. Съвременна организация на финансовата статистика* |
| **Тема ІІ. Финансовите операции в Системата на националните сметки** | 4 | 1 | 2 | 0 | 4 | 1 |
| *1. Същност и принципи на изграждане на СНС2. Основни понятия и класификации в СНС3. Институционални единици, сектори и сметки в СНС4. Същност на финансовите сметки в СНС5. Информационно осигуряване на съставянето на финансовите сметки в СНС* |
| **Тема ІІІ. Статистическо изучаване на консолидирания държавен бюджет** | 6 | 2 | 4 | 1 | 6 | 2 |
| *1. Същност и задачи на статистическото изучаване на консолидирания държавен бюджет2. Правна регламентация, принципи и правила при подготвянето приемането и изпълнението на консолидирания държавен бюджет3. Информационно осигуряване на статистическото изучаване консолидирания държавен бюджет4. Единна бюджетна класификация5. Система от показатели за характеризиране на консолидирания държавен бюджет6. Статистически методи за анализ на консолидирания държавен бюджет* |
| **Тема ІV. Статистическо изучаване на държавния дълг** | 4 | 2 | 2 | 1 | 4 | 2 |
| *1. Същност и задачи на статистическото изучаване на държавния дълг2. Методология на статистическото изучаване на държавния дълг3. Система от показатели за характеризиране на държавния дълг4. Статистически методи за анализ на държавния дълг* |
| **Тема V. Статистическо изучаване на паричното обращение** | 6 | 2 | 2 | 1 | 6 | 2 |
| *1. Паричното обращение като обект на статистическото изучаване2. Организация на статистическото изучаване на паричното обращение3. Структура на паричния отчет4. Статистически методи за анализ на обема и структурата на паричното обращение* |
| **Тема VІ. Статистическо изучаване на дейността на търговските банки** | 6 | 2 | 3 | 1 | 6 | 2 |
| *1. Дейността на търговските банки като обект на статистическото изучаване2. Информационно осигуряване на статистическото изучаване на дейността на търговските банки3. Система от показатели за характеризиране на дейността на търговските банки4. Статистически методи за анализ на дейността на търговските банки* |
| **Тема VІІ. Статистическо изучаване на застрахователната дейност** | 6 | 2 | 3 | 1 | 6 | 2 |
| *1. Застрахователната дейност като обект на статистическото изучаване2. Основни понятия, съвкупности, единици и признаци3. Информационно осигуряване на статистическото изучаване на застрахователната дейност4. Система от показатели за характеризиране на застрахователната дейност* |
| **Тема VІІІ. Статистическо изучаване на инвестициите** | 4 | 1 | 2 | 1 | 4 | 1 |
| *1. Същност и задачи на статистическо изучаване на инвестициите2. Информационно осигуряване на статистическото изучаване на преките чуждестранни инвестиции3. Информационно осигуряване на статистическото изучаване на разходите за придобиване на ДМА4. Система от показатели за характеризиране на инвестициите5. Статистически методи за анализ на инвестициите* |
| **Тема ІХ. Статистическо изучаване дейността на борсите** | 4 | 1 | 2 | 1 | 4 | 1 |
| *1. Същност и задачи на борсовата статистика2. Правна регламентация и функциониране на капиталовия пазар в България3. Информационно осигуряване на статистическото изучаване на борсовата търговия4. Система от статистически показатели за дейността на фондовите борси5. Статистически методи за анализ на показателите за борсовата търговия* |
| **Общо:** | **42** | **14** | **21** | **7** | **42** | **14** |

**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 |   |
| 2. Интернет | X |   |
| 3. Специализирани програмни продукти: |  |  |
|  3.1   | 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., Славева, К. (2016). Финансова статистика. Свитък с изпитни материали за дистанционно обучение. Свищов: АИ „Ценов”. |
|  4. Петков, П. (2020). Иконометрия с Gretl. Свищов, АИ "Ценов ". |

 **6.2. Допълнителна литература**

|  |
| --- |
|  1. Ръководство за държавна финансова статистика в България в съответствие с изискванията на ръководството GFS86 на МВФ |
|  2. Салин, В. Н. и др. (2002). Статистика финансов. Москва: Финансы и статистика. |
|  3. Ерусалимов, Р., Василев, В., Йорданов, П. и др. (2019). Въведение в застраховането |
|  4. Проданов, Ст. (2020). Инвестиции и инвестиционни решения: методико-приложни аспекти. Би |
|  5. Божинов, Б. (2013). Въведение в банковото дело. Свищов: АИ „Ценов“. |
|  6. Вътев, Ж. (2015). Анализ на банковата дейност. Русе: Авангард Принт. |
|  7. Мейсън, А. (2000). Финансова математика и статистика. Международен банков институт, С. |
|  8. Mills. T. C. (1999). The Econometric Modeling of Financial Time Series. 2nd edition. Cambridge University Press. Cambridge |
|  9. Teall, J. L., Hasan, I. (2002). Quantitative Methods for Finance and Investments. Iowa State Blackwell Publishing USA Press |
|  10. 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" |
|  11. Ангелова, П. (2017). Основи на статистиката. Свищов, АИ "Ценов". |
|  12. Славева, К.(2018). Методология и методика на емпиричните изследвания – модул „Статистика“. Електронно учебно пособие. Свищов. |
|  13. Петков, П. (2020). Иконометрия - учебно пособие за дистанционно обучение. Свищов, АИ “Ценов”. |
|  14. Тримесечно издание „Икономически преглед |
|  15. Тримесечно издание „Банките в България“ |
|  16. Тримесечно издание „Пазар на държавни ценни книжа“ |
|  17. Месечно издание „Информационен бюлетин“ |
|  18. Икономически бюлетин на ЕЦБ |
|  19. Статистически годишник |
|  20. Списание "Статистика" |
|  21. Списание "Финанси" |
|  22. Месечен обзор на българската икономика |
|  23. Europe in Figures – Eurostat yearbook |

 **6.3. Нормативни документи**

|  |
| --- |
|  1. Закон за статистиката |
|  2. Закон за БНБ |
|  3. Кодекс на застраховането |
|  4. Закон за кредитните институции |
|  5. 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/ |
|  6. Кoдекс на Европейската статистическа практика |
|  7. Методология за разработване на национални финансови сметки за България ЗА БЪЛГАРИЯ |
|  8. Методология държавен дефицит/излишък по подсектори на "Държавно управление" и равнище на дълга |
|  9. 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 |
|  10. Закон за пазарите на финансови инструменти |

 **6.4. Интернет ресурси**

|  |
| --- |
|  1. www.nsi.bg/ |
|  2. www.bnb.bg |
|  3. http://www.minfin.bg |
|  4. www.fsc.bg/ |
|  5. www.ecb.europa.eu/ecb/html/index.bg.html |
|  6. http://www.bse-sofia.bg/ |
|  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) |
|  …………………………………(доц. д-р Пламен Петков) |

Ръководител катедра:

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