МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт управления и территориального развития

УТВЕРЖДАЮ
Проректор
по образовательной деятельности КФУ
Проф. Минзарипов Р.Г.
_____
"___"_____20___ г.

Программа дисциплины

Методы анализа неопределенности в экономике Б2.ДВ.2

Направление подготовки: 080100.62 - Экономика
Профиль подготовки: не предусмотрено
Квалификация выпускника: бакалавр
Форма обучения: очное
Язык обучения: русский
Автор(ы):
Малаев В.В.
Рецензент(ы):
Сингатуллина Г.Р. , Тумашев А.Р.

СОГЛАСОВАНО:
Заведующий(ая) кафедрой: Сафиуллин Л. Н.
Протокол заседания кафедры No ___ от "____" _____ 201__г
Учебно-методическая комиссия Института управления и территориального развития:
Протокол заседания УМК No ____ от "____" _____ 201__г

Регистрационный No

Казань
2014

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Малаев В.В. кафедра экономической методологии и истории отделение управления территориями , Vladimir.Malaev@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

формирование у студентов системы знаний об основных видах неопределенности в рыночной экономике, основных методах управления неопределенностью, основных применяемых процедурах управления неопределенностью

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б2.ДВ.2 Общепрофессиональный" основной образовательной программы 080100.62 Экономика и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 3 курсе, 5 семестр.

Данная учебная дисциплина входит в раздел Общепрофессиональных дисциплин.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК-1 (общекультурные компетенции)	- владеет культурой мышления, способен к обобщению, анализу, восприятию информации, постановке цели и выбору путей ее достижения
ОК-11 (общекультурные компетенции)	осознает социальную значимость своей будущей профессии, обладает высокой мотивацией к выполнению профессиональной деятельности
ОК-13 (общекультурные компетенции)	владеет основными методами, способами и средствами получения, хранения, переработки информации, имеет навыки работы с компьютером как средством управления информацией, способен работать с информацией в глобальных компьютерных сетях
ОК-4 (общекультурные компетенции)	- способен анализировать социально-значимые проблемы и процессы, происходящие в обществе, и прогнозировать возможное их развитие в будущем
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способен на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-3 (профессиональные компетенции)	способен выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами
ПК-4 (профессиональные компетенции)	способен осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения поставленных экономических задач

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-5 (профессиональные компетенции)	способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы
ПК-10 (профессиональные компетенции)	способен использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии
ПК-6 (профессиональные компетенции)	способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты
ПК-7 (профессиональные компетенции)	способность анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений
ПК-8 (профессиональные компетенции)	способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей
ПК-9 (профессиональные компетенции)	способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

1. основные классификации неопределенности.

2. основные применяемые критерии и методы в сфере устранения или минимизации неопределенности;

3. отечественный и зарубежный опыт в области управления неопределенностью.

2. должен уметь:

уметь применять полученные знания при рассмотрении конкретных ситуаций.

3. должен владеть:

1. основными положениями методологии анализа и оценки неопределенности;

2. методами оценки и прогнозирования неопределенности в рыночной экономике.

1. Знать основные классификации неопределенности.

2. Применять основные критерии и методы в сфере устранения или минимизации неопределенности;

3. Знать и применять отечественный и зарубежный опыт в области управления неопределенностью.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен в 5 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Сущность управления неопределенностью.	5	1	2	2	0	
2.	Тема 2. Функции управления неопределенностью.	5	2	2	2	0	
3.	Тема 3. Соотношение понятий риск и неопределенность.	5	3	2	2	0	
4.	Тема 4. Методы управления неопределенностью	5	4	2	2	0	
5.	Тема 5. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.	5	5	2	2	0	
6.	Тема 6. Методы оценки неопределенности.	5	6	2	2	0	домашнее задание
7.	Тема 7. Методы оценки и управления неопределенностью в рыночной экономике.	5	7	2	2	0	реферат
8.	Тема 8. Макроэкономическая неопределенность на мировом рынке.	5	8	2	2	0	устный опрос
9.	Тема 9. Неопределенность на внутреннем валютном рынке.	5	9	2	2	0	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
10.	Тема 10. Инфляционная составляющая анализа неопределенности в экономике.	5	10	2	2	0	реферат
11.	Тема 11. Личностные факторы влияющие на процесс принятия решений.	5	11	2	2	0	устный опрос
12.	Тема 12. Управление неопределенностью как инструмент принятия управленческих решений	5	12	2	3	0	домашнее задание
13.	Тема 13. Страхование как способ минимизации неопределенности.	5	13	2	3	0	домашнее задание
.	Тема . Итоговая форма контроля	5		0	0	0	экзамен
	Итого			26	28	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Сущность управления неопределенностью.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Современная теория управления неопределенностью: основные этапы развития. Роль управления неопределенностью в рыночной экономике. Мотивация интереса к управлению неопределенностью. Основные характеристики управления неопределенностью в рыночной среде.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Основные методы измерения неопределенности: вероятностные модели, распределение вероятностей.

Тема 2. Функции управления неопределенностью.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Мониторинг внешней и внутренней среды. Планирование. Организационная функция. Мотивация. Регулирующая функция. Функция контроля и учета.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Мониторинг внешней и внутренней среды. Планирование. Организационная функция. Мотивация. Регулирующая функция. Функция контроля и учета.

Тема 3. Соотношение понятий риск и неопределенность.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Сравнение ситуаций риска и неопределенности.Финансовые риски: сущность, классификация. Понятие финансового риска. Виды рисков: Кредитный риск. Рыночный риск. Операционный риск. Риск ликвидности. Другие виды финансового риска. Особенности проявления юридического риска.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Сравнение ситуаций риска и неопределенности.Финансовые риски: сущность, классификация. Понятие финансового риска. Виды рисков: Кредитный риск. Рыночный риск. Операционный риск. Риск ликвидности. Другие виды финансового риска. Особенности проявления юридического риска.

Тема 4. Методы управления неопределенностью

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Экономические методы управления неопределенностью : Методы измерения. Методы уклонения. Методы локализации . Методы диссипации. Методы компенсации. Социальные и психологические методы управления неопределенностью. Административные и научно-прикладные методы управления неопределенностью.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Экономические методы управления неопределенностью : Методы измерения. Методы уклонения. Методы локализации . Методы диссипации. Методы компенсации. Социальные и психологические методы управления неопределенностью. Административные и научно-прикладные методы управления неопределенностью.

Тема 5. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Сравнение ситуаций риска и неопределенности. Критерий Лапласа. Критерий Вальда. Критерий Сэвиджа. Критерий Гурвица. Изменчивость, стандартное отклонение и дисперсия.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Сравнение ситуаций риска и неопределенности. Критерий Лапласа. Критерий Вальда. Критерий Сэвиджа. Критерий Гурвица. Изменчивость, стандартное отклонение и дисперсия.

Тема 6. Методы оценки неопределенности.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Метод дерева решений. Метод причины-следствия. Метод деревьев отказов. Метод индексов опасности.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Метод дерева решений. Метод причины-следствия. Метод деревьев отказов. Метод индексов опасности.

Тема 7. Методы оценки и управления неопределенностью в рыночной экономике.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Методика Value-at-risk. 1.1. История метода Value-at-risk. 1.2. Метод вариации-ковариации. 1.3. Метод исторического моделирования. 1.4. Метод статистических испытаний. Традиционные методы оценки.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Методика Value-at-risk. 1.1. История метода Value-at-risk. 1.2. Метод вариации-ковариации. 1.3. Метод исторического моделирования. 1.4. Метод статистических испытаний. Традиционные методы оценки.

Тема 8. Макроэкономическая неопределенность на мировом рынке.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Внешнеэкономические отношения государств. Макроэкономическая нестабильность национальной экономики. Неопределенность процентных ставок, прогнозирование изменений процентных ставок.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Внешнеэкономические отношения государств. Макроэкономическая нестабильность национальной экономики. Неопределенность процентных ставок, прогнозирование изменений процентных ставок.

Тема 9. Неопределенность на внутреннем валютном рынке.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Конверсия валюты и наращивание процентов. Зависимость валютных курсов от объективных и субъективных факторов.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Конверсия валюты и наращивание процентов. Зависимость валютных курсов от объективных и субъективных факторов.

Тема 10. Инфляционная составляющая анализа неопределенности в экономике.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Прогнозирование инфляции, инфляционная премия. Связь процентной ставки с уровнем инфляции. Методы снижения инфляции. Взаимодействие денежного и фондового рынков.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Прогнозирование инфляции, инфляционная премия. Связь процентной ставки с уровнем инфляции. Методы снижения инфляции. Взаимодействие денежного и фондового рынков.

Тема 11. Личностные факторы влияющие на процесс принятия решений.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Недостатки существующих систем оценки неопределенности. Критика теории ?рационального человека?. Теории перспективы и ментального учета.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Недостатки существующих систем оценки неопределенности. Критика теории ?рационального человека?. Теории перспективы и ментального учета.

Тема 12. Управление неопределенностью как инструмент принятия управленческих решений

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Факторы возникновения концепции управления неопределенностью. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Экспертные процедуры. Проблемы сравнительной оценки выбора вариантов управленческих решений

практическое занятие (3 часа(ов)):

Факторы возникновения концепции управления неопределенностью. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Экспертные процедуры. Проблемы сравнительной оценки выбора вариантов управленческих решений

Тема 13. Страхование как способ минимизации неопределенности.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Сущность страхования. Основные характеристики страховых контрактов. Преимущества и недостатки страхования.Стратегии хеджирования. Эффективность хеджирования. Стоимость хеджирования.

практическое занятие (3 часа(ов)):

Сущность страхования. Основные характеристики страховых контрактов. Преимущества и недостатки страхования.Стратегии хеджирования. Эффективность хеджирования. Стоимость хеджирования.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
6.	Тема 6. Методы оценки неопределенности.	5	6	подготовка домашнего задания	1	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
				1.Знакомство с программой и содержанием курса Методы анализа неопределенности в экономике. Изучение	2	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
7.	Тема 7. Методы оценки и управления неопределенностью в рыночной экономике.	5	7	Изучение теоретического материала по курсу Методы анализа неопределенности в экономике. Разбор ситуа	2	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
				подготовка к реферату	1	реферат
8.	Тема 8. Макроэкономическая неопределенность на мировом рынке.	5	8	Подготовка к практическим занятиям по курсу. Подготовка эссе и выступлений.	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
				подготовка к устному опросу	1	устный опрос
9.	Тема 9. Неопределенность на внутреннем валютном рынке.	5	9	подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
				Подготовка к практическим занятиям по курсу Методы анализа неопределенности в экономике. Подготовка	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. .
10.	Тема 10. Инфляционная составляющая анализа неопределенности в экономике.	5	10	Подготовка к занятиям, сбор необходимой информации, разбор ситуаций. решение задач самостоятельно.	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
				подготовка к реферату	1	реферат

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
11.	Тема 11. Личностные факторы влияющие на процесс принятия решений.	5	11	Подготовка к занятиям, сбор необходимой информации, разбор ситуаций. решение задач самостоятельно.	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
				подготовка к устному опросу	1	устный опрос
12.	Тема 12. Управление неопределенностью как инструмент принятия управленческих решений	5	12	подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
				Подготовка к занятиям, сбор необходимой информации, разбор ситуаций. решение задач самостоятельно.	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
13.	Тема 13. Страхование как способ минимизации неопределенности.	5	13	подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
				Подготовка к занятиям, сбор необходимой информации, разбор ситуаций. решение задач самостоятельно. П	1	Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя.
	Итого				18	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

При проведении аудиторных занятий используются активные и интерактивные формы занятий в сочетании с внеаудиторной работой.

Образовательные технологии:

1. лекции,
2. практические занятия,

3. самостоятельная работа студентов.

Содержание контактных часов:

а) разбор контрольных работ;

б) сдача обязательных конспектов и научных сообщений;

в) сдача обязательных конспектов для пропустивших занятия;

г) консультации по проведению выступлений-презентаций;

д) консультации по научным сообщениям.

Особенности курса

Курс "Методы анализа неопределенности в экономике" - интенсивный курс по подготовке экономистов широкого профиля.

В курсе анализируются различные методики управления неопределенностью, особенности различных подходов к оценке неопределенности, а также процесс формирования экспертных и количественных методов оценки.

Курс "Методы анализа неопределенности в экономике" готовит к практической деятельности, которая требует принятия решений в условиях ограниченной информации. Лектор останавливается не на всех, а на наиболее важных вопросах. Лекция - первый этап подготовки к семинару.

Особенности семинаров. К семинарам надо готовиться всем студентам по всем вопросам (независимо от того, кто делает выступления-презентации).

Полная неподготовленность к семинару приравнивается к пропуску занятия. Свидетельством неподготовленности является отказ от ответа на вопрос семинарского занятия. Кроме того, для проверки подготовки всей группы преподаватель может использовать контрольную по вопросам семинара в начале занятия. Помимо текущих контрольных работ во время семинарских занятий студенты пишут две базовые контрольные работы, которые включают как теоретические вопросы по пройденным темам, так и задачи и вопросы на рассуждение, в которых необходимо самостоятельно использовать все полученные знания и прийти к тем или иным выводам в рамках конкретных ситуаций.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Сущность управления неопределенностью.

Тема 2. Функции управления неопределенностью.

Тема 3. Соотношение понятий риск и неопределенность.

Тема 4. Методы управления неопределенностью

Тема 5. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.

Тема 6. Методы оценки неопределенности.

домашнее задание , примерные вопросы:

Метод дерева решений. Метод причины-следствия. Метод деревьев отказов. Метод индексов опасности.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Метод дерева решений. Метод причины-следствия. Метод деревьев отказов. Метод индексов опасности.

Тема 7. Методы оценки и управления неопределенностью в рыночной экономике.

реферат , примерные темы:

Особенности формирования рыночной экономике в переходных экономиках.
Неопределенность в рамках процесса трансформации экономической системы.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Особенности формирования рыночной экономике в переходных экономиках. Неопределенность в рамках процесса трансформации экономической системы.

Тема 8. Макроэкономическая неопределенность на мировом рынке.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Внешнеэкономические отношения государств. Макроэкономическая нестабильность национальной экономики. Неопределенность процентных ставок, прогнозирование изменений процентных ставок.

устный опрос , примерные вопросы:

Внешнеэкономические отношения государств. Макроэкономическая нестабильность национальной экономики. Неопределенность процентных ставок, прогнозирование изменений процентных ставок.

Тема 9. Неопределенность на внутреннем валютном рынке.

домашнее задание , примерные вопросы:

Конверсия валюты и наращивание процентов. Зависимость валютных курсов от объективных и субъективных факторов.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. . , примерные вопросы:

Конверсия валюты и наращивание процентов. Зависимость валютных курсов от объективных и субъективных факторов.

Тема 10. Инфляционная составляющая анализа неопределенности в экономике.

реферат , примерные темы:

Прогнозирование инфляции, инфляционная премия. Связь процентной ставки с уровнем инфляции. Методы снижения инфляции. Взаимодействие денежного и фондового рынков.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Прогнозирование инфляции, инфляционная премия. Связь процентной ставки с уровнем инфляции. Методы снижения инфляции. Взаимодействие денежного и фондового рынков.

Тема 11. Личностные факторы влияющие на процесс принятия решений.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Недостатки существующих систем оценки неопределенности. Критика теории "рационального человека". Теории перспективы и ментального учета.

устный опрос , примерные вопросы:

Недостатки существующих систем оценки неопределенности. Критика теории "рационального человека". Теории перспективы и ментального учета.

Тема 12. Управление неопределенностью как инструмент принятия управленческих решений

домашнее задание , примерные вопросы:

Факторы возникновения концепции управления неопределенностью. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Экспертные процедуры. Проблемы сравнительной оценки выбора вариантов управленческих решений

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Факторы возникновения концепции управления неопределенностью. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Экспертные процедуры. Проблемы сравнительной оценки выбора вариантов управленческих решений

Тема 13. Страхование как способ минимизации неопределенности.

домашнее задание , примерные вопросы:

Сущность страхования. Основные характеристики страховых контрактов. Преимущества и недостатки страхования.

Сдача материалов, разбор ситуаций и решения задач в контактные часы преподавателя. , примерные вопросы:

Сущность страхования. Основные характеристики страховых контрактов. Преимущества и недостатки страхования.

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

Форма контроля по дисциплине - экзамен. Экзамен предполагает компоненты итоговой и текущей оценки знаний студентов в семестре. Текущая оценка знаний в семестре проводится в ходе практических занятий (семинаров и групповых консультаций), а также по результатам промежуточного контроля в форме проведения двух контрольных точек.

1.Роль анализа неопределенности в современной экономике.

Основные методы измерения: вероятностные модели, распределение вероятностей.

2.Соотношение понятий риск и неопределенность.

3.Социальные и психологические методы минимизации неопределенности.

4.Административные и научно-прикладные методы минимизации неопределенности.

5.Методы уклонения.

6.Методы локализации.

7.Методы диссипации.

8.Методы компенсации.

9.Критерий Лапласа.

10.Критерий Вальда.

11.Критерий Сэвиджа.

12.Критерий Гурвица.

13.Изменчивость, стандартное отклонение и дисперсия.

14.Методика Value-at-risk.

15.Метод вариации-ковариации.

16.Метод исторического моделирования.

17.Внешнеэкономические отношения государств.

18.Макроэкономическая нестабильность национальной экономики.

19.Неопределенность процентных ставок, прогнозирование изменений процентных ставок.

20.Ограниченность информации в кредитной сфере.

21.Недостатки существующих систем оценки неопределенности.

22.Критика теории "рационального человека".

23.Теория перспективы и ментального учета.

24.Связь процентной ставки с уровнем инфляции.

25.Прогнозирование инфляции, инфляционная премия.

26.Методы снижения инфляции.

27.Взаимодействие денежного и фондового рынков.

28.Средние и переменные величины процентов.

29.Экспертные процедуры.

30.Проблемы сравнительной оценки выбора вариантов управленческих решений

31.Расчет и анализ точки безубыточности.

32.Анализ коэффициентов безопасности проекта по постоянным затратам, по средним переменным затратам, по цене.

33.Форвардные и фьючерсные контракты: основные характеристики и особенности торговли.

34.Определение форвардной и фьючерсной цены. Фьючерсный рынок и спот-рынок.
35.Стоимость хеджирования.
36.Стратегии хеджирования.
37.Основные характеристики страховых контрактов.
38.Преимущества и недостатки страхования.

7.1. Основная литература:

1. Просветов Г.И. Математические методы в экономике. 3-е издание - М.: Издательство РЛД, 2007.
2. Просветов Г.И. Финансовый менеджмент: Задачи и решения - М.: Альфа-пресс, 2007.
3. Просветов Г.И. Математика в экономике: Задачи и решения. - М.: Издательство РЛД, 2005.
4. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций. - М:"Дашков и К", 2006.

7.2. Дополнительная литература:

1. Артеменко О. Модель расчета предполагаемой вероятности дефолта и ее использование в оценке стоимости долговых инструментов. // Рынок ценных бумаг. -2000. -№9.
2. Буренин А.Н. Рынки производных финансовых инструментов. - М: ИНФРА-М, 1996.
3. Волкова В. Выбор акций для портфельного инвестирования.// Финансовый бизнес. -2000. -№ 2.
4. Гмурман В.Е. Теория вероятностей и математическая статистика. - М: Высшая школа, 1977.
5. Егорова Е.Е Системный подход оценки риска. // Управление риском. -2002. -№2. -С.12-13.
6. Данин Д. Вероятностный мир. - М: Знание, 1981.
7. Денисов И. О построении торговых систем на российском фондовом рынке. - М: журнал "Рынок ценных бумаг" №7, 1999.
8. Долан Э.Дж., Кэмпбелл К.Д., Кэмпбелл Р.Дж. Деньги, банковское дело и денежно-кредитная политика. - М-Л: ДваТри, 1991.
9. Демшин В. Оценка стоимости: доходный подход и безрисковая норма доходности.// Рынок ценных бумаг. -2001. -№ 12. -С. 35-39.
10. Константинов А. Портфельное инвестирование на российском рынке акций.//Финансист,2000, №8, с. 28-31.
11. Кузнецов В.Е. Измерение финансовых рисков. // Банковские технологии. -1997. -№7. -С. 76-78.
12. Кордемский Б.А. Математика изучает случайности. - М: Просвещение, 1975.
13. Королькевич В.А. Дилинг и ценные бумаги. Англо-русский словарь терминов и определений. - М: Ось-89, 1996.
14. Маршал Джон Ф., Бансал Викул К. Финансовая инженерия: полное руководство по финансовым нововведениям. - М: ИНФРА-М, 1998.
15. Рукин А. Портфельные инвестиции. Финансово - математические методы.// Рынок ценных бумаг, 1999, № 18, с. 45-47.
16. Роуз П.С. Банковский менеджмент. - М: ДЕЛО Лтд, 1995.
17. Синки Дж. Ф. Управление финансами в коммерческих банках. - М: Catallaxy, 1994.
18. Слуцкий Л. Активный и пассивный портфельный менеджмент.// Банковские технологии, 1998, июль, с. 74-77.
19. Смирнов В. Экспресс - оценка стоимости акций в российских реалиях.// Рынок ценных бумаг. -2001. -№ 12. -С. 31-35.
20. Сурков Г. Границы применимости методологии VaR для оценки рыночных рисков. // Финансист. -2002. -№9. -С. 63-71.

21. Фаррахов И.Т. Расчет лимитов межбанковского кредитования. // Оперативное управление и стратегический менеджмент в коммерческом банке. -2001. -№4. -С. 98-104.
22. Шарп У.Ф., Александер Г.Дж., Бэйли Д.В. Инвестиции. - М: ИНФРА-М, 1997.

7.3. Интернет-ресурсы:

Практика ключевых индикаторов для операционных рисков - www.sas.com/russia.

Риски - http://www.risk.net.

Риски - http://www.globalriskregulator.com.

Риски - http://www.operationalriskonline.com.

Риски - www.bankir.ru.

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Освоение дисциплины "Методы анализа неопределенности в экономике" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "КнигаФонд", доступ к которой предоставлен студентам. Электронно-библиотечная система "КнигаФонд" реализует легальное хранение, распространение и защиту цифрового контента учебно-методической литературы для вузов с условием обязательного соблюдения авторских и смежных прав. КнигаФонд обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям новых ФГОС ВПО.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 080100.62 "Экономика" и профилю подготовки не предусмотрено .

Автор(ы):
Малаев В.В. _____
"__" _____ 201 __ г.

Рецензент(ы):
Сингатуллина Г.Р. _____
Тумашев А.Р. _____
"__" _____ 201 __ г.