

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич
Должность: врио ректора
Дата подписания: 28.09.2022 16:20:04
Уникальный программный ключ:
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf55f08

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
ФГБОУ ВО «Тверской государственный университет»

Утверждаю:

Руководитель ООП:

Толкаченко О.Ю.

«20» апреля 2022 г.



Рабочая программа дисциплины (с аннотацией)

МОДЕЛИРОВАНИЕ РИСКОВЫХ СИТУАЦИЙ

Направление подготовки

38.03.01 Экономика

Профиль подготовки

«Финансы и кредит»

Для студентов очной и заочной формы обучения

Составитель:

к.ф.-м.н., доцент Крылов Ю. Н.

Тверь, 2022

I. Аннотация

1. Наименование дисциплины в соответствии с учебным планом

Моделирование рискованных ситуаций.

2. Цель и задачи дисциплины

Целью изучения дисциплины является развитие системного мышления у студентов в области моделирования и анализа рискованных ситуаций в экономических объектах и явлениях, а также подготовка студентов к выполнению трудовых функций В/01.6 «Мониторинг спроса и предложения микрофинансового рынка» из профессионального стандарта «Специалист по микрофинансовым операциям» №238н от 22.04.2015 г. и С/03.7 «Подготовка аналитических отчетов, а также обзоров, докладов, рекомендаций, проектов нормативных документов на основе статистических расчетов» из профессионального стандарта «Статистик» №605н от 08.09.2015 г.

Задачами освоения дисциплины являются:

- формирование твердых теоретических знаний и практических навыков по теории и методам снижения влияния рисков на эффективность работы экономических объектов;
- развитие навыков адекватного выбора специальных приемов и методов анализа, осуществления аналитических процедур при принятии оптимальных экономических решений в условиях неопределенности и риска.

3. Место дисциплины в структуре ООП

Дисциплина относится к дисциплинам по выбору вариативной части структуры ООП федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата).

Данная дисциплина логически и содержательно опирается на предшествующие ей дисциплины: «Математический анализ», «Линейная

алгебра», «Экономическая информатика», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Финансы», «Статистика».

Требования к «входным» знаниям и умениям обучающихся, необходимым для освоения изучаемой дисциплины:

- Знать методы и уметь анализировать функции многих переменных;
- Знать и практически использовать необходимые и достаточные условия существования экстремумов функции многих переменных;
- Знать методы и уметь решать задачи линейного и нелинейного программирования;
- Знать методы и уметь использовать плотность и законы распределения случайных величин в различных вероятностных расчетах;
- Знать и уметь оценивать статистические характеристики случайных величин, в том числе и характеристик их стохастической взаимосвязи.

Данная дисциплина является предшествующей для следующих дисциплин: «Методы оптимальных решений», «Экономика фирмы», «Инвестиции», «Менеджмент», «Деньги, кредит, банки», «Теория отраслевых рынков», «Иностранные инвестиции», «Управление предпринимательскими рисками», «Анализ статистической отчетности предприятия», «Основы теории оценочной деятельности, «Страхование».

4. Объем дисциплины:

Для очной формы обучения (набор 2019, 2020 года): 3 зачетных единицы, 108 академических часов, в том числе контактная работа: лекции 19 часов, практические занятия 19 часов, лабораторные работы 0 часов, самостоятельная работа: 70 часов.

Для заочной формы обучения – нормативный срок обучения (набор 2018, 2019, 2020 года): 3 зачетных единицы, 108 академических часов, в том числе контактная работа: лекции 6 часов, практические занятия 6 часов, лабораторные работы 0 часов, самостоятельная работа: 92 часов., контроль 4 часа.

Для заочной формы обучения – сокращенный срок обучения (набор 2019, 2020 года): 3 зачетных единицы, 108 академических часов, в том числе

контактная работа: лекции 4 часов, практические занятия 4 часов, лабораторные работы 0 часов, **самостоятельная работа:** 96 часов., **контроль** 4 часа.

5. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы (формируемые компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
<p>ОПК-3= Способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы.</p>	<p>Второй (промежуточный, углублённый) уровень Владеть: методами оценки рыночных и специфических рисков, навыками применения теории и методов моделирования и рискованных ситуаций для решения экономических задач. Уметь: идентифицировать и анализировать рыночные и специфические риски, применять методы моделирования и анализа рискованных ситуаций для определения рациональных решений по уменьшению влияния рисков в различных экономических задачах. Знать: методы анализа рыночных и специфических рисков, основные методы моделирования и анализа рискованных ситуаций для решения экономических задач.</p>
<p>ПК-3 = Способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами.</p>	<p>Первый (начальный, пороговый) уровень Владеть: технологиями расчётов показателей рисков; навыками применения современных математических методов и математических моделей для оценки рискованных решений в сложных рыночных условиях. Уметь: идентифицировать и адаптировать модели в конкретных управленческих ситуациях. выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей. Знать: основы моделирования рисков в экономике: виды и алгоритмы построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей с учётом рисков; типовые методики расчета риска в экономических и социально-экономических показателях.</p>

6. Форма промежуточной аттестации - зачёт.

7. Язык преподавания русский.