

Министерство образования и науки Республики Казахстан
Карагандинский государственный технический университет

«Утверждаю»
Председатель Ученого Совета,
ректор, академик НАН РК
_____ Газалиев А.М.
« ____ » _____ 2015 г.

**ПРОГРАММА ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ СТУДЕНТА
(SYLLABUS)**

дисциплина UP 2211 «Управление рисками»

Модуль PUPSKS 21 «Предпринимательство и управление рисками в СКС»
Специальность 5В090400 –«Социально-культурный сервис»

Факультет инженерной экономики и менеджмента
Кафедра инженерное предпринимательство и маркетинг

Предисловие

Программа обучения по дисциплине для студента (syllabus) разработана:
Проф., д.э.н. Стеблякова Л.П.

Обсуждена на заседании кафедры организации производства

Протокол № 1 от «27» августа 2015 г.

Зав. кафедрой _____
(подпись)

Одобрена учебно-методическим советом ФЭМ
Протокол № _____ от «_____» _____ 2015 г.

Председатель _____
(подпись)

Сведения о преподавателе и контактная информация

Стеблякова Л.П. д.э.н., проф. кафедры ОП

Кафедра «Инженерное предпринимательство и маркетинг» находится в 4 корпусе КарГТУ (Б.Мира, 56), аудитория 220, контактный телефон (87212) 56-59-35 (доп. 1998).

Трудоемкость дисциплины

| Семестр | Количество кредитов | ECTS | Вид занятий | | | | | Количество часов СРС | Общее количество часов | Форма контроля |
|---------|---------------------|------|-----------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-------------|----------------------|------------------------|------------------|
| | | | количество контактных часов | | | количество часов СРСП | всего часов | | | |
| | | | лекции | практические занятия | Лабораторные занятия | | | | | |
| 3 | 2 | 3 | 15 | 15 | - | 30 | 60 | 30 | 90 | Тестовые задания |

Характеристика дисциплины

Дисциплина «Управление рисками» входит в цикл базовых дисциплин как компонент по выбору.

Цель дисциплины

Дисциплина «Управление рисками» ставит целью

Задачи дисциплины

В результате изучения данной дисциплины студенты должны: **иметь представление о:**

- современных направлениях экономико-математического моделирования, как на уровне микроэкономики так и на уровне макроэкономики;
- основных методах анализа экономических данных для принятия решений и моделирования социально-экономических процессов;
- подходах к применению на практике методов качественного и количественного анализа, моделирования и прогнозирования числовой и нечисловой экономической информации;

знать:

- основные подходы к прогнозированию экономических показателей;
- основные модели анализа микро - макроэкономики, в частности модели поведения потребителей и производителей, многосекторные линейные модели и динамические модели экономики; основные подходы к моделированию экономических показателей;

уметь:

- пользоваться методами анализа данных, моделирования и прогнозирования процессов; методами описательной статистики и робастного оценивания, многомерного шкалирования, корреляционного, дисперсионного, факторного, кластерного, дискриминантного анализа, применять методы, используя пакеты прикладных программ;

приобрести практические навыки:

- обоснования управленческих решений на основе анализа данных, моделирования и прогнозирования процессов.

Пререквизиты

Для изучения данной дисциплины необходимо усвоение следующих дисциплин:

| Дисциплина | Наименование разделов (тем) |
|--------------------------------------|--|
| 1. Экономическая теория | Основные типы и модели экономических систем |
| 2. Статистические методы в экономике | Пошаговая регрессия. Ряд динамики. Автокорреляция переменных. Автокорреляция. |
| 3. Информатика | Текстовый редактор Microsoft Word Электронные таблицы MS Excel |
| 4. Микроэкономика | Издержки производства Рынки факторов производства |
| 5. Макроэкономика | Основные макроэкономические показатели |

Постреквизиты

Знания, полученные при изучении дисциплины «Анализ данных и прогнозирование экономики», могут использоваться при выполнении дипломной работы.

Тематический план дисциплины

| Наименование раздела, (темы) | Трудоемкость по видам занятий, ч. | | | | |
|--|-----------------------------------|--------------|--------------|------|-----|
| | Лекции | практические | лабораторные | СРСП | СРС |
| Раздел 1. Анализ данных | | | | | |
| 1 Типы экономических данных | 2 | - | - | 3 | 4 |
| 2. Методы представления данных | 2 | 3 | | 4 | 4 |
| Раздел 2. Анализ временных рядов | | | | | |
| 1 Компоненты временного ряда. | 2 | 2 | | 4 | 4 |
| 2 Прогнозирование с моделями временных рядов | 2 | 6 | | 4 | 4 |
| Раздел 3. Многомерный статистический анализ | | | | | |
| 1 Многомерное шкалирование | 2 | 2 | | 3 | 4 |
| 2 Факторный и компонентный анализ | 2 | 2 | | 4 | 4 |
| 3 Кластерный анализ | 2 | - | | 4 | 4 |
| 4 Дискриминантный анализ | 1 | - | - | 4 | 2 |
| ИТОГО | 15 | 15 | | 30 | 30 |

Перечень практических занятий

1. Методы представления данных
2. Компоненты временного ряда
3. Прогнозирование с моделями временных рядов
4. Многомерное шкалирование
5. Факторный и компонентный анализ

Темы контрольных заданий для СРС

1. Характеристика статистических данных в экономике.
2. Выделение тренда временного ряда.
3. Статистические оценки. Доверительные области
4. Корреляционный анализ.
5. Прогнозирование в экономике
6. Многомерное шкалирование.
7. Дискриминантный анализ
8. Факторный анализ.
9. Метод главных факторов
10. Экспоненциальное сглаживание.
11. Определение порядков авторегрессионной модели.
12. Примеры динамических моделей с распределенными лагами.
13. Выделение тренда временного ряда
14. Дисперсионный анализ.
15. Методы кластерного анализа

Критерии оценки знаний студентов

Экзаменационная оценка по дисциплине определяется как сумма максимальных показателей успеваемости по рубежным контролям (до 60%) и итоговой аттестации (экзамен) (до 40%) и составляет значение до 100%.

График выполнения и сдачи заданий по дисциплине

| Вид контроля | Цель и содержание задания | Рекомендуемая литература | Продолжительность выполнения | Форма контроля | Срок сдачи | Баллы |
|-------------------------------------|---|--|------------------------------|----------------|-----------------|-------|
| Практическое решение задач | Практическое закрепление навыков | [1],[2],[3],[4],[5],[6],[7],[8],[9],[11][11],[12],[15],[6][17],18,[19],[20][21]. | 1-14 неделя | Текущий | 2,4,6,8,10,12 | 7 |
| Выполнение заданий СРСП | Закрепление теоретических знаний и практических навыков | Конспекты лекций, материалы занятий по контролируемым темам | 1-14 неделя | Текущий | 1-14 неделя | 28 |
| Выполнение заданий СРС | Освоение темы и ответ на вопросы, предложенные для обсуждения | Весь перечень основной и дополнительной литературы | 1-14 неделя | Текущий | 1-14 неделя | 15 |
| Тестовый опрос (2 блока аттестации) | Закрепление теоретических знаний и практических навыков | Весь перечень основной и дополнительной литературы | 1 контактный час | Рубежный | 7, 14 неделя | 10 |
| Экзамен | Проверка усвоения материала дисциплины | Весь перечень основной и дополнительной литературы | 1 контактный час | Итоговый | В период сессии | 40 |
| Итого | | | | | | 100 |

Политика и процедуры

При изучении дисциплины «Анализ данных и прогнозирование экономики» прошу соблюдать следующие правила:

- 1 Не опаздывать на занятия.
- 2 Не пропускать занятия без уважительной причины, в случае болезни прошу представить справку, в других случаях – объяснительную записку.
- 3 В обязанности студента входит посещение всех видов занятий.
- 4 Согласно календарному графику учебного процесса сдавать все виды контроля.
- 5 Пропущенные практические и лабораторные занятия отрабатывать в указанное преподавателем время.

Список основной литературы

1. Дубров А.М., Мхитарян В.С., Трошин Л.И. Многомерные статистические методы. - М.: Финансы и статистика, 2012.
2. Ниворожкина Л.И., Арженский С.В. Многомерные статистические методы в экономике: Учебник.- М.: Изд. - торговая корпорация «Дашков и К», Ростов н/д: Наука - Спектр, 2011 -224с.
3. Дуброва Т.А. Статистические методы прогнозирования. - М.: ЮНИТИ, 2011.
4. Эконометрика/ Под ред. Елисеевой И.И.- М.: Финансы и статистика, 2009.
5. Паклин Н.Б., Орешков В.И. Бизнес-аналитик: от данных к знаниям (+СД). Учебное пособие. 2- ое изд., перераб. и доп. – Спб Питер, 2010. -704с.

Список дополнительной литературы

6. Эконометрика: Учебник/ Под ред. Мхитаряна В.А.С. - М.: Проспект, 2009. – 288 с.
7. Экономико - статистический анализ /Под ред. Ильенковой С.Д. - М.: ЮНИТИ, 2002.
8. Парсаданов Г.А. Прогнозирование и планирование социально-экономической системы страны. - М.: ЮНИТИ, 2001.
9. Лугачев М.И., Ляпунов Ю.Р. Методы социально-экономического прогнозирования. - М.: ТЕИС, 2011.
10. Басовский Л.Е. Прогнозирование и планирование в условиях рынка - М.: ИНФРА - М, 2011.
11. Ковырь О.П. Анализ данных и исследование операций. М.: Экономика, 2012.
12. Татарова Г.Г. Методология анализа данных. М.: Экономика, 2011.
13. Аубакирова Г.М. Моделирование и прогнозирование экономических процессов. Учебное пособие. Караганда: КарГТУ, 2007.

ПРОГРАММА ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ СТУДЕНТА (SYLLABUS)

дисциплина ADPE 2219 «Анализ данных и прогнозирование экономики»

Модуль DGMPE 25 «Дополнительные главы математики и
моделирование экономики»

Гос. изд. лиц. № 50 от 31.03.2004.

Подписано к печати _____ 20__ г. Формат 90x60/16. Тираж _____ экз.

Объем ___ уч. изд. л. Заказ № _____ Цена договорная

100027. Издательство КарГТУ, Караганда, Бульвар Мира, 56