



Реквізити навчальної дисципліни

Назва дисципліни	Аналіз економічних і фінансових ризиків
Назва дисципліни англійською мовою	Analysis of economic and financial risks
Код дисципліни	17/с
Рівень вищої освіти	Перший (бакалавр)
Галузь знань	12 Інформаційні технології
Спеціальність	124 «Системний аналіз»
Освітня програма	Системний аналіз і управління
Статус дисципліни	Вибіркова
Форма навчання	очна(денна)
Рік підготовки, семестр	4 курс, весняний семестр
Обсяг дисципліни	4 кредити ЄКТС
Семестровий контроль/ контрольні заходи	залік
Мова викладання	Українська
Розміщення курсу	https://classroom.google.com/c/NTM2NjcyNjMwNjQy?cjc=6ra7uyi
Кадрове забезпечення	
Кафедра, що	
Забезпечує викладання	Кафедра штучного інтелекту
Викладач (лекційні заняття)	старший викладач, PhD, Гуськова В.Г.
E-mail та інші контакти	guskovavera2009@gmail.com https://orcid.org/0000-0001-7637-201X
Викладач (лабораторні заняття)	старший викладач, PhD, Гуськова В.Г.
E-mail та інші контакти	guskovavera2009@gmail.com
Цілі та предметні результати навчання	

Цілі дисципліни	Метою даної дисципліни є підготовка фахівців з системного аналізу, здатних розв'язувати комплексні проблеми в галузі професійної та/або дослідницько-інноваційної діяльності у сфері системного аналізу, що передбачає глибоке переосмислення наявних та створення нових цілісних знань та/або професійної практики стосовно аналізу даних, моделюванню даних, математичному моделюванню і прогнозуванню на основі статистичних та експериментальних даних у формі часових рядів або багатокритеріальних задач.
Компетентності	<p>ФК 3. Здатність будувати математично коректні моделі статичних та динамічних процесів і систем із зосередженими та розподіленими параметрами із врахуванням невизначеності зовнішніх та внутрішніх факторів.</p> <p>ФК 4. Здатність визначати основні чинники, які впливають на розвиток фізичних, економічних, соціальних процесів, відокремлювати в них стохастичні та невизначені показники, формулювати їх у вигляді випадкових або нечітких величин, векторів, процесів та досліджувати залежність між ними.</p> <p>ФК 7. Здатність використовувати сучасні інформаційні технології для комп'ютерної реалізації математичних моделей та прогнозування поведінки конкретних систем, а саме: об'єктно-орієнтований підхід при проектуванні складних систем різної природи, прикладні математичні пакети, застосування баз даних і знань</p>
Програмні результати навчання	<p>ПР 12. Застосовувати методи і засоби роботи з даними і знаннями, методи математичного, логіко-семантичного, об'єктного та імітаційного моделювання, технології системного і статичного аналізу.</p> <p>ПР 14. Розуміти і застосовувати на практиці методи статичного моделювання і прогнозування, оцінювати вихідні дані</p> <p>ПР 3. Вміти визначати ймовірнісні розподіли стохастичних показників та факторів, що впливають на характеристики досліджуваних процесів, досліджувати властивості та знаходити характеристики багатовимірних випадкових векторів та використовувати їх для розв'язання прикладних задач, формалізувати стохастичні показники та фактори у вигляді випадкових величин, векторів, процесів</p>

1. Пререквізити та постреквізити дисципліни (місце в структурно-логічній схемі навчання за відповідною освітньою програмою)

Курс “Аналіз економічних і фінансових ризиків” є одним із провідних курсів професійної підготовки бакалаврів спеціальності “Системний аналіз фінансового ринку”.

Навчальна дисципліна «Аналіз економічних і фінансових ризиків» укладається одночасно з курсом «Основи системного аналізу», «Теорія прийняття рішень» та «Моделювання складних систем». Базою для даної дисципліни виступають «Методи оптимізації та дослідження операцій», «Основи системного аналізу»,

«Теорія керування» та «Теорія прийняття рішень». Отриманні знання є основою для написання диплому бакалавра.

Матеріали курсу широко використовуються в таких курсах: «Системи і методи підтримки прийняття рішень», «Машинне навчання», «Байєсівський аналіз даних», «Нейромережеве моделювання і прогнозування».

2. Зміст навчальної дисципліни

Кредитний модуль включає теми, подані нижче.

Розділ 1. Поняття ризику в економічній та фінансовій сферах.

Тема 1.1. Визначення економічних та фінансових ризиків, їх класифікація

Тема 1.2. Ризики, їх невизначеність та ймовірність настання

Тема 1.3. Величина ризику та прибуток від ризику

Розділ 2. Розділ 2. Класифікація факторів ризику

Тема 2.1. Загальні підходи до класифікації ризиків

Тема 2.2. Класифікація ризиків за втратами

Розділ 3. Управління ризиками, методи управління ризиками

Тема 3.1. Концепція управління ризиками, поняття управління ризиками

Тема 3.2. Загальні системи управління ризиками

Тема 3.3. Методи ухилення від ризиків

Тема 3.4. Методи локалізації ризиків та методи компенсації ризиків

Розділ 4. Методи оцінювання ризиків

Тема 4.1. Загальні підходи до оцінювання ризиків

Тема 4.2. Статистичні методи оцінювання ризиків, розрахунково-аналітичні методи оцінювання ризиків

Тема 4.3. Методи експертних оцінок в оцінювання ризиків

Розділ 5. Аналіз та обробка початкових даних за видами ризиків

Тема 5.1. Аналіз бази знань та даних, експертна оцінка початкових даних

Тема 5.2. Фільтрація та нормалізація початкових даних

Тема 5.3. Заповнення пропусків даних, методи формування пропусків даних

Тема 5.4. Математичне моделювання та аналіз результатів моделювання

Тема 5.5. Прогнозування та аналіз результатів прогнозування

Лабораторні роботи

№ п/п	Найменування лабораторної роботи	Кількість годин
-------	----------------------------------	-----------------

ЛР №1	Поняття ризику в економічній та фінансовій сферах, їх класифікація	6
ЛР №2	Фільтрація та нормалізація ризиків, заповнення пропусків у початкових наборах даних	6
ЛР №3	Моделювання та прогнозування ризиків, сценарії розвитку подальших кроків	6

Крім лабораторних занять заплановано також **консультативні заняття** для більш поглибленого вивчення окремих розділів курсу. На початку семестру кожен студент обирає тему з якою буде працювати, знайомиться з літературою, робить огляд літератури по темі і готує набір даних для подальшого виконання роботи. На консультативному занятті кожен студент виступає з презентацією і проводиться дискусія по представленій/обраній темі, ставляться питання, а також надаються рекомендації щодо подальших кроків у роботі.

Перелік тем набору даних (приклад)

1	Store Sales - Time Series Forecasting https://www.kaggle.com/competitions/store-sales-time-series-forecasting/data
2	COVID-19 Visualizations https://www.kaggle.com/code/neelkudu28/covid-19-visualizations-predictions-forecasting
3	Food Demand Forecasting https://www.kaggle.com/datasets/kannanaikkal/food-demand-forecasting
4	Wind Power Forecasting https://www.kaggle.com/datasets/theforcecoder/wind-power-forecasting
5	Forecasting From Gold Price https://www.kaggle.com/datasets/arashnic/learn-time-series-forecasting-from-gold-price
6	Weekly Corn Price https://www.kaggle.com/datasets/nickwong64/corn2015-2017

Контрольна робота та самостійна роботи. Вивчення дисципліни крім лекцій та практичних занять, включає контрольну роботу та самостійну роботу: підготовка до аудиторних занять; виконання та оформлення лабораторних робіт, підготовка до захисту лабораторних робіт. Контрольна робота складається із тем, які були пройдені протягом семестру навчання.

Політика навчальної дисципліни (освітнього компонента)

Викладач повинен звернути увагу студентів на те, що дисципліна Аналіз економічних і фінансових ризиків – це дисципліна, що займається аналізом, розробкою та застосуванням методів та технологій інтелектуального аналізу даних в прикладних задачах математичного моделювання, прогнозування, розпізнавання образів, класифікації, кластерного аналізу, а також

інших методів в різних областях людської діяльності при роботі з часовими рядами або багатокритеріальними задачами.

Рекомендовані методи навчання: експертна оцінка, метод пошуку закономірностей, мозковий штурм, імітаційні методи і моделі, опитування студентів.

Студенту рекомендується вести докладний конспект лекцій, вивчати матеріали, які були відправлені лектором, фіксувати основні результати лабораторних занять та оформлювати їх у вигляді звіту.

Важливим аспектом якісного засвоєння матеріалу, відпрацювання прийомів і алгоритмів вирішення основних завдань дисципліни є самостійна робота, що дозволяє перетворити отримані знання в об'єкт власної діяльності. Самостійна робота включає в себе читання літератури, корисних посилань, наданих лектором, виконання огляду літератури за обраною тематикою, виконання звітів по лабораторних роботах, підготовку до їх захисту та підготовка до написання контрольної роботи, а також підготовка до заліку.

В процесі проведення лекцій та лабораторних робіт контролюється присутність студентів на заняттях, наприкінці кожного заняття перевіряються отримані результати і на основі їх перевірки відмічається виконання лабораторних робіт. Після обробки отриманих результатів та оформлення протоколів лабораторних робіт відбувається їх захист, на якому задаються теоретичні та практичні запитання згідно з програмою відповідної роботи. Лабораторні роботи виконуються як індивідуально, так і в групах по 3-4 студенти. Якість відповідей оцінюється згідно рейтингової системи кожного із учасника.

Види контролю та рейтингова система оцінювання результатів навчання (PCO)

Поточний контроль: лабораторні роботи та контрольна робота.

Календарний контроль: проводиться один раз на семестр як моніторинг поточного стану виконання вимог силабусу.

Рейтингова система оцінювання включає всі види тестування: контрольні роботи, активність на лабораторних заняттях та якість захисту лабораторних робіт, а також якість фінального захисту роботи та виступу з презентацією. Кожен студент отримує свій підсумковий рейтинг по дисципліні, а також проміжні оцінки, які може відслідковувати у кампусі або у гуглкласрумі.

Рейтинг студента з кредитного модуля складається з балів, які він отримує за:

- написання контрольної роботи;
- робота на лабораторних заняттях та захист лабораторних робіт;
- захист фінальної роботи, яка виконувалась протягом семестру;
- відповіді на заліку.

Система рейтингових (вагових) балів та критеріїв оцінювання:

Метод оцінювання	Мінімальна оцінка в балах	Максимальна оцінка в балах
Лабораторна робота 1	10	15
Лабораторна робота 2	10	20
Лабораторна робота 3	20	30
Контрольна робота	5	10
Залік	15	25

Сума стартових балів та балів за екзамен/ залік переводиться до екзаменаційної оцінки згідно з таблицею:

100...95	Відмінно
94...85	Дуже добре
84...75	Добре
74...65	Задовільно
64...60	Достатньо
Менше 60	Незадовільно
стартовий рейтинг менше 35 балів	Не допущено

Якщо студент отримав за рейтингом <35 балів і по початку заліку не виконав необхідний обсяг роботи, то він НЕ допускається до заліку та відправляється на перездачу (перед цим здавши всі необхідні лабораторні).

Рекомендована література

1. Базова

1. Arrou K.J. Aspekts of the Theory of Risk - Bearing/Jahnisoning Saatio, Helsinki, 1965. -680 с.
2. E. M. Gram Lich. Benfit Cost Analysis of Government Programs. In: Pensions, Labor, and Individuals Choise, D.A. Wise ed. Chicago: University of Chicago Press, 1985. - p. 215.
3. E. Mansfield. Microeconomics. New York: W.W. Norton. 6th ed., 1988.
4. Green, J. and E. Sheshinski Optimal capital - gains taxation uncler Limited information, Jornal of Political Economy, 1978 - № 4.
5. Hall R.E. "Investment, interest rates, and the effects of Stabilization policies", Brooking Economics Rewiev, 1967. - 414 p.

2. Допоміжна

1. Helliwell, J.E. "Aggregate Investment: Selected Reaclings", Pengium, Harmonclnorth, 1976. -313 p.
2. King M.A, Taxation, corporate financial policy and the cost of capital - a comment, Jornal of Public Economiecs, 1975. - 279 p.
3. M.O. Hurd, J. B. Shoven The Distributional Impact of Social Security. - In: Pensions, Labor, and Individuals Choise, D.A. Wise ed. Chicago: University of Chicago Press, 1985. p.215.
4. Sen A.K. Oh Economic Inguality. Oxford: Clarendon Press, 1973. 25.Charles R. Kennedy, Political Risk Management, 1987, p.7.

1. Додаткова інформація з дисципліни (освітнього компонента)

- можливість зарахування сертифікатів проходження дистанційних чи онлайн курсів за відповідною тематикою.

Робочу програму навчальної дисципліни (силабус) склав:

старший викладач кафедри математичних методів системного аналізу

Гуськова Віра Геннадіївна

Ухвалено кафедрою ММСА (протокол № 13 від 05.06.2024)

Погоджено Методичною комісією ІІСА (протокол № 10 від 24.06.2024)