



СИСТЕМИ ТА МЕТОДИ ПРИЙНЯТТЯ ФІНАНСОВИХ РІШЕНЬ

Викладач: доктор фіз.-мат. Наук, професор, Козін Ігор Вікторович

Кафедра: економічної кібернетики, 5-й корпус ЗНУ, ауд.113

Е-mail: ainc00@gmail.com

Телефон:

Інші засоби зв'язку:

Освітня програма, рівень вищої освіти	Економічна кібернетика бакалавр					
Статус дисципліни	Нормативна/вибіркова					
Кредити ECTS 6		Навч. рік	2023-24	Рік навчання	Тижні	16
Кількість годин 150		Кількість змістових модулів¹	8	2-й	Лекційні заняття – 22 Практичні заняття – 22 Самостійна робота – 106	
Вид контролю	Залік					
Посилання на курс в Moodle[^]	https://moodle.znu.edu.ua/course/view.php?id=6637					
Консультації: 2 год на тиждень за розкладом	кількість на тиждень, тривалість, формат (за розкладом, за домовленістю, особисто чи дистанційно)					

ОПИС КУРСУ

Мета курсу «Системи та методи прийняття фінансових рішень»: набуття фундаментальних теоретичних знань і практичних навичок з питань постановки та розв'язування задач, щодо створення та застосування математичних моделей на рівні управління виробництвом. Підготувати кваліфікованих спеціалістів у сфері управління фінансами та керування сучасними економічними системами.

ОЧІКУВАНІ РЕЗУЛЬТАТИ НАВЧАННЯ

У разі успішного завершення курсу студент **зможе**:

- розв'язувати задачі з теорії фінансових рішень;
- оцінювати сценарії фінансових поведінок економічних агентів
- розраховувати прибутковість фінансових інструментів, та обґрунтовувати доцільність їх використання;
- обчислювати структуру оптимального фінансового портфелю;
- знаходити оптимальний розподіл грошей між фінансовими проектами.

Заплановані робочою програмою результати навчання та компетентності	Методи і контрольні заходи
1	2
ЗК-02 Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу. ЗК-08 Здатність проводити дослідження на відповідному	Репродуктивні методи (лекція, пояснення, робота з методичними матеріалами).

¹ 1 змістовий модуль = 15 годин (0,5 кредита ECTS)



<p>рівні.</p> <p>СК-04 Здатність використовувати сучасні інформаційні технології, методи та прийоми дослідження економічних та соціальних процесів, адекватні встановленим потребам дослідження.</p> <p>СК-12 Здатність знаходити, обробляти, інтерпретувати економічні дані та використовувати їх для дослідження процесів у сфері економічної діяльності на базі застосування математичних методів, моделей та комп'ютерних технологій.</p> <p>СК-13 Здатність моделювати проблеми управління у сфері економіки та їх наслідки і пропонувати можливі шляхи вирішення із використанням економіко-математичних методів, моделей та сучасних інформаційних технологій.</p>	<p>Наочні методи (схеми, моделі, алгоритми). Дискусійні методи.</p>
<p>ПРН-04 Розробляти соціально-економічні проекти та систему комплексних дій щодо їх реалізації з урахуванням їх цілей, очікуваних соціально-економічних наслідків, ризиків, законодавчих, ресурсних та інших обмежень.</p> <p>ПРН-10 Застосовувати сучасні інформаційні технології та спеціалізоване програмне забезпечення в соціально-економічних дослідженнях та в управлінні соціально-економічними системами.</p> <p>ПРН-11 Визначати та критично оцінювати стан та тенденції соціально-економічного розвитку, формувати та аналізувати моделі економічних систем та процесів.</p> <p>ПРН-16 Здійснювати комплексний аналіз складних економічних систем, зіставляти та порівнювати їх складові, оцінювати та аргументувати ефективність їх функціонування.</p> <p>ПРН-17 Досліджувати та прогнозувати розвиток соціально-економічних систем на основі системного підходу та з використанням сучасних інформаційних технологій.</p>	<p>Методи контролю і самоконтролю: усний, письмовий. Самостійно-пошукові методи (лабораторна робота). Контрольні заходи: – захист лабораторних робіт; – теоретичне тестування за кожним розділом; – залік.</p>

ОСНОВНІ НАВЧАЛЬНІ РЕСУРСИ

Презентації лекцій, плани семінарських занять, методичні рекомендації до виконання індивідуальних завдань розміщені на платформі Moodle:

<https://moodle.znu.edu.ua/course/view.php?id=6637>

КОНТРОЛЬНІ ЗАХОДИ

Поточні контрольні заходи:

Поточний контроль здійснюється у вигляді лабораторних робіт за темами та вигляді коротких тестувань (10 питань). Передбачено 8 лабораторних робіт, кожна з яких оцінюється в 6 балів та 2 тестових завдання по 6 балів. Тестування проводяться в системі Moodle.

Підсумкові контрольні заходи:

Підсумковий семестровий контроль складається з двох частин

- 1. Індивідуальне завдання за темами з заданого переліку тем. Максимальна оцінка – 20 балів*
- 2. Підсумковий тест (Moodle) або опитування – Максимальна оцінка – 20 балів*



Контрольний захід			Термін виконання	% від загальної оцінки
Поточний контроль (max 60%)				
розділ 1	Змістовий модуль 1	Лабораторна робота 1	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 2	Лабораторна робота 2	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 3	Лабораторна робота 3	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 4	Лабораторна робота 4	За розкладом занять	5
		Тестування	За розкладом занять	10
розділ 2	Змістовий модуль 5	Лабораторна робота 5	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 6	Лабораторна робота 6	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 7	Лабораторна робота 7	За розкладом занять	5
	Змістовий модуль 8	Лабораторна робота 8	За розкладом занять	5
		Тестування	За розкладом занять	10
Підсумковий контроль (max 40%)				
<i>Підсумковий тест або/та опитування</i>				
				40
Разом				100%

Шкала оцінювання: національна та ECTS

За шкалою ECTS	За шкалою університету	За національною шкалою	
		Екзамен	Залік
A	90 – 100 (відмінно)	5 (відмінно)	Зараховано
B	85 – 89 (дуже добре)	4 (добре)	
C	75 – 84 (добре)		
D	70 – 74 (задовільно)	3 (задовільно)	
E	60 – 69 (достатньо)	2 (незадовільно)	Не зараховано
FX	35 – 59 (незадовільно – з можливістю повторного складання)		
F	1 – 34 (незадовільно – з обов'язковим повторним курсом)		

РОЗКЛАД КУРСУ ЗА ТЕМАМИ І КОНТРОЛЬНІ ЗАВДАННЯ

Тиждень і вид заняття	Тема заняття	Контрольний захід	Кількість балів
		Змістовий модуль 1	
Тиждень 1 Лекція 1	Механізми вибору та основні принципи	Лабораторна робота 1	5

ЗАПОРІЗЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
Економічний факультет
Силабус навчальної дисципліни



Лабораторна робота 1	прийняття фінансових рішень.		
		Змістовий модуль 2	
Тиждень 2 Лекція 2 Лабораторна робота 2	Прийняття рішення в умовах невизначеності. Поняття ризику. Вимірювання ризиків.	Лабораторна робота 2	5
		Змістовий модуль 3	
Тиждень 3 Лекція 3 Лабораторна робота 3	Основні сучасні моделі прийняття фінансових рішень.	Лабораторна робота 3	5
		Змістовий модуль 4	
Тиждень 4 Лекція 4-5 Лабораторна робота 4	Прийняття рішень методами теорії ігор.	Тестування Лабораторна робота 4	15
		Змістовий модуль 5	
Тиждень 6 Лекція 6 Лабораторна робота 5	Модель поведінки учасників фінансового ринку. Стратегія хеджування. Спекулятивна стратегія.	Лабораторна робота 5	5
		Змістовий модуль 6	
Тиждень 7 Лекція 7 Лабораторна робота 6	Задача розподілу грошей між проектами	Лабораторна робота 6	5
		Змістовий модуль 7	
Тиждень 8-9 Лекція 8-9 Лабораторна робота 7	Неманіпульовані механізми вибору. Механізм ключових агентів.	Лабораторна робота 7	5
		Змістовий модуль 8	
Тиждень 10-11 Лекція 8 Лабораторна робота 8	Правила голосування.	Тестування Лабораторна робота 8	15

ОСНОВНІ ДЖЕРЕЛА

Основна:

1. Прийняття рішень: теорія та практика: підручник / А.В. Катренко та ін.; за наук. ред. В.В.Пасічника. Львів : «Новий Світ-2000», 2021. 446 с.
2. Негрей М., Тужик К. Теорія прийняття рішень. Видавництво "Центр навчальної літератури", 2018. 272 с.
3. Ймовірнісне та статистичне моделювання в Excel для прийняття рішень. Навч. посіб./ Н.Г.Бишовець та ін. Київ: Видавництво Ліра-К, 2019. 200 с
4. Василевич Л. Ф. Юртин І.І. Прийняття рішень за умов конфлікту та невизначеності середовища: навч. посіб. Київ : Київ. ун-т ім. Б. Грінченка. 2013. 128 с.

Додаткова:

1. Файнзільберг Л.С., Жуковська О.А., Якимчук .Теорія прийняття рішень : підручник для студентів спеціальності "Комп'ютерні науки та інформаційні технології" . Київ: Освіта України, 2018. 246 с.



2. 6. Кузьмін О.Є., Жовтанецька О.О., Заяць Н.О. Системний аналіз і прийняття інноваційних рішень: навчальний посібник. Львів : Видавництво «Новий Світ-2000», 2021. 226с.
3. Козін І. Принципи симетрії в теорії прийняття рішень. Запоріжжя : Поліграф, 2007. 164 с.
4. Zhang X, Xu L, Zhang H, Jiang Z, Cai W. Emergy based intelligent decision-making model for remanufacturing process scheme integrating economic and environmental factors. Journal of Cleaner Production. 2021; 291:125247
5. Sun C. Research on investment decision-making model from the perspective of “Internet of Things + Big data”. Future Generation Computer Systems. 2020; 107: 286-292
6. Мунтян В. І. Основи теорії інформаційної моделі економіки. Київ : КВІЦ. 368 с.
7. Baird D., Gertner R., Picker R. Game Theory and the Law. Cambr., Mass., London : Harvard University Press, 1994.
8. Rasmusen E. Games and Information: An Introduction to Game Theory. Oxford : Blackwell, 1996.

Інформаційні ресурси

1. Теорія прийняття рішень. URL: <http://www.math.nsc.ru/LBRT/k5/or.html>.
2. Міністерство економіки України: офіційний вебсайт. URL: <http://www.me.gov.ua/>
3. Державна служба статистики України: офіційний вебсайт. URL: www.ukrstat.gov.ua
4. Прозорро: вебсайт. URL: <https://prozorro.gov.ua/>
5. Агентство з розвитку інфраструктури фондового ринку України (АРІФРУ): вебсайт URL: <https://www.smida.gov.ua/about>
6. Національний інститут стратегічних досліджень. Офіційний вебсайт: URL: <http://www.niss.gov.ua>
7. Нормативні акти України. Офіційний вебсайт: URL: www.nau.kiev.ua 7. Сервер Верховної Ради України. Офіційний вебсайт: URL: <http://www.rada.gov.ua>
8. Національний банк України. Офіційний вебсайт: URL: <https://bank.gov.ua/>

РЕГУЛЯЦІЯ І ПОЛІТИКИ КУРСУ²

Відвідування занять. Регуляція пропусків.

Інтерактивний характер курсу передбачає обов'язкове відвідування практичних занять. Студенти, які за певних обставин не можуть відвідувати практичні заняття регулярно, мусять впродовж тижня узгодити із викладачем графік індивідуального відпрацювання пропущених занять. Окремі пропущені завдання мають бути відпрацьовані на найближчій консультації впродовж тижня після пропуску. Відпрацювання занять здійснюється усно у формі співбесіди за питаннями, визначеними планом заняття. В окремих випадках дозволяється письмове відпрацювання шляхом виконання індивідуального письмового завдання.

Студенти, які станом на початок екзаменаційної сесії мають понад 70% невідпрацьованих пропущених занять, до відпрацювання не допускаються.

Політика академічної доброчесності

Усі письмові роботи, що виконуються слухачами під час проходження курсу, перевіряються на наявність плагіату за допомогою спеціалізованого програмного забезпечення UniCheck. Відповідно до чинних правових норм, плагіатом вважатиметься: копіювання чужої наукової роботи чи декількох робіт та оприлюднення результату під своїм іменем; створення суміші власного та запозиченого тексту без належного цитування джерел; рерайт (перепарфразування чужої праці без згадування оригінального автора). Будь-яка ідея, думка чи речення, ілюстрація чи

² Тут зазначається все, що важливо для курсу: наприклад, умови допуску до лабораторій, реактивів тощо. Викладач сам вирішує, що треба знати студенту для успішного проходження курсу!



фото, яке ви запозичуєте, має супроводжуватися посиланням на першоджерело. Приклади оформлення цитувань див. на Moodle: <https://moodle.znu.edu.ua/mod/resource/view.php?id=103857>
Виконавці індивідуальних дослідницьких завдань обов'язково додають до текстів своїх робіт власноруч підписану Декларацію академічної доброчесності (див. посилання у Додатку до силабусу).

Роботи, у яких виявлено ознаки плагіату, до розгляду не приймаються і відхиляються без права перескладання. Якщо ви не впевнені, чи підпадають зроблені вами запозичення під визначення плагіату, будь ласка, проконсультуйтеся з викладачем.

Висока академічна культура та європейські стандарти якості освіти, яких дотримуються у ЗНУ, вимагають від дослідників відповідального ставлення до вибору джерел. Посилання на такі ресурси, як Wikipedia, бази даних рефератів та письмових робіт (Studopedia.org та подібні) є неприпустимим. Рекомендовані бази даних для пошуку джерел:

Електронні ресурси Національної бібліотеки ім. Вернадського: <http://www.nbuv.gov.ua>

Цифрова повнотекстова база даних англomовної наукової періодику JSTOR: <https://www.jstor.org/>

Використання комп'ютерів/телефонів на занятті

Використання мобільних телефонів, планшетів та інших гаджетів під час лекційних та практичних занять дозволяється виключно у навчальних цілях (для уточнення певних даних, перевірки правопису, отримання довідкової інформації тощо). Будь ласка, не забувайте активувати режим «без звуку» до початку заняття.

Під час виконання заходів контролю (тестів, контрольних робіт, іспитів) використання гаджетів заборонено. У разі порушення цієї заборони роботу буде анульовано без права перескладання.

Комунікація

Базовою платформою для комунікації викладача зі студентами є Moodle.

Важливі повідомлення загального характеру – зокрема, оголошення про терміни подання контрольних робіт, коди доступу до сесій розміщуються викладачем на форумі курсу. Для персональних запитів використовується сервіс приватних повідомлень. Відповіді на запити студентів подаються викладачем впродовж тижня, або на чергові консультації.

Якщо за технічних причин доступ до Moodle є неможливим, або ваше питання потребує термінового розгляду, направте електронного листа з позначкою «Важливо» на адресу ainc@ukrpost.net. У листі обов'язково вкажіть ваше прізвище та ім'я, курс та шифр академічної групи.



ДОДАТОК ДО
ДОДАТОК ДО СИЛАБУСУ ЗНУ – 2023-2024 рр.

ГРАФІК ОСВІТНЬОГО ПРОЦЕСУ 2023-2024 н. р. доступний за адресою:
<https://tinyurl.com/yckze4jd>.

АКАДЕМІЧНА ДОБРОЧЕСНІСТЬ. Студенти і викладачі Запорізького національного університету несуть персональну відповідальність за дотримання принципів академічної доброчесності, затверджених **Кодексом академічної доброчесності ЗНУ:** <https://tinyurl.com/ya6yk4ad>. Декларація академічної доброчесності здобувача вищої освіти (додається в обов'язковому порядку до письмових кваліфікаційних робіт, виконаних здобувачем, та засвідчується особистим підписом): <https://tinyurl.com/y6wzzlu3>.

НАВЧАЛЬНИЙ ПРОЦЕС ТА ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ЯКОСТІ ОСВІТИ. Перевірка набутих студентами знань, навичок та вмінь (атестації, заліки, іспити та інші форми контролю) є невід'ємною складовою системи забезпечення якості освіти і проводиться відповідно до Положення про організацію та методику проведення поточного та підсумкового семестрового контролю навчання студентів ЗНУ: <https://tinyurl.com/y9tve4lk>.

ПОВТОРНЕ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІН, ВІДРАХУВАННЯ. Наявність академічної заборгованості до 6 навчальних дисциплін (в тому числі проходження практики чи виконання курсової роботи) за результатами однієї екзаменаційної сесії є підставою для надання студенту права на повторне вивчення зазначених навчальних дисциплін. Порядок повторного вивчення визначається Положенням про порядок повторного вивчення навчальних дисциплін та повторного навчання у ЗНУ: <https://tinyurl.com/y9pkmmp5>. Підстави та процедури відрахування студентів, у тому числі за невиконання навчального плану, регламентуються Положенням про порядок переведення, відрахування та поновлення студентів у ЗНУ: <https://tinyurl.com/yeds57la>.

НЕФОРМАЛЬНА ОСВІТА. Порядок зарахування результатів навчання, підтверджених сертифікатами, свідоцтвами, іншими документами, здобутими поза основним місцем навчання, регулюється Положенням про порядок визнання результатів навчання, отриманих у неформальній освіті: <https://tinyurl.com/y8gbt4xs>.

ВИРІШЕННЯ КОНФЛІКТІВ. Порядок і процедури врегулювання конфліктів, пов'язаних із корупційними діями, зіткненням інтересів, різними формами дискримінації, сексуальними домаганнями, міжособистісними стосунками та іншими ситуаціями, що можуть виникнути під час навчання, регламентуються Положенням про порядок і процедури вирішення конфліктних ситуацій у ЗНУ: <https://tinyurl.com/57wha734>. Конфліктні ситуації, що виникають у сфері стипендіального забезпечення здобувачів вищої освіти, вирішуються стипендіальними комісіями факультетів, коледжів та університету в межах їх повноважень, відповідно до: Положення про порядок призначення і виплати академічних стипендій у ЗНУ: <https://tinyurl.com/yd6bq6p9>; Положення про призначення та виплату соціальних стипендій у ЗНУ: <https://tinyurl.com/y9r5dpwh>.

ПСИХОЛОГІЧНА ДОПОМОГА. Телефон довіри практичного психолога Марті Ірини Вадимівни (061)228-15-84, (099)253-78-73 (щоденно з 9 до 21).

УПОВНОВАЖЕНА ОСОБА З ПИТАНЬ ЗАПОБІГАННЯ ТА ВИЯВЛЕННЯ КОРУПЦІЇ
Запорізького національного університету: **Борисов Костянтин Борисович**
Електронна адреса: uv@znu.edu.ua Гаряча лінія: Тел. [\(061\) 228-75-50](tel:+380612287550)



РІВНІ МОЖЛИВОСТІ ТА ІНКЛЮЗИВНЕ ОСВІТНЄ СЕРЕДОВИЩЕ. Центральні входи усіх навчальних корпусів ЗНУ обладнані пандусами для забезпечення доступу осіб з інвалідністю та інших маломобільних груп населення. Допомога для здійснення входу у разі потреби надається черговими охоронцями навчальних корпусів. Якщо вам потрібна спеціалізована допомога, будь-ласка, зателефонуйте (061) 228-75-11 (начальник охорони). Порядок супроводу (надання допомоги) осіб з інвалідністю та інших маломобільних груп населення у ЗНУ: <https://tinyurl.com/ydhcsagx>.

РЕСУРСИ ДЛЯ НАВЧАННЯ. Наукова бібліотека: <http://library.znu.edu.ua>. Графік роботи абонементів: понеділок – п'ятниця з 08.00 до 16.00; вихідні дні: субота і неділя.

ЕЛЕКТРОННЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ НАВЧАННЯ (MOODLE): <https://moodle.znu.edu.ua>

Якщо забули пароль/логін, направте листа з темою «Забув пароль/логін» за адресою: moodle.znu@znu.edu.ua.

У листі вкажіть: прізвище, ім'я, по-батькові українською мовою; шифр групи; електронну адресу. Якщо ви вказували електронну адресу в профілі системи Moodle ЗНУ, то використовуйте посилання для відновлення паролю <https://moodle.znu.edu.ua/mod/page/view.php?id=133015>.

Центр інтенсивного вивчення іноземних мов: <http://sites.znu.edu.ua/child-advance/>

Центр німецької мови, партнер Гете-інституту: <https://www.znu.edu.ua/ukr/edu/ocznu/nim>

Школа Конфуція (вивчення китайської мови): <http://sites.znu.edu.ua/confucius>