

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Теория принятия решений в условиях риска

Автор: Д.э.н., профессор Левин М.И.

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.01 Экономика, Поведенческая экономика

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции в сфере ведения организационной и управленческой деятельности с учетом аспектов психологии экономических агентов, а также в сфере научно-исследовательской работы.

План курса:

Тема 1. Основные понятия теории вероятностей.

Случайные события и случайные величины. Функция распределения случайных величин. Условные вероятности, формула Байеса. Нормальное распределение. Центральная предельная теорема. Примеры использования нормального распределения для принятия решений. Ошибки первого и второго рода. Статистические оценки. Элементы теории шкал. Коэффициенты корреляции.

Тема 2. Элементы принятия решений при неопределенности.

Риск и неопределенность. Объективные и субъективные вероятности. Функция полезности и ожидаемая функция полезности. Аксиоматика. Подход Неймана-Моргенштерна. Неприятие риска. Примеры принятия решений при неопределенности. Использование средних и среднеквадратических отклонений в оценке рисков. Полезность, зависящая от состояний. Применение: «ценность жизни». Стохастическое доминирование. Рыночное равновесие при неопределенности.

Тема 3. Информация и принятие решений.

Основные концепции информационного подхода в принятии решений. Принятие решений на основе полной и неполной информации. Оптимальные действия и потеря информации. Более информативные и менее информативные источники информации. Коллективное принятие решений. Экспертные мнения. Групповой выбор. Рациональные ожидания.

Тема 4. Асимметрия информации

Равновесия в теории игр. Игры с частной информацией. Эволюционное равновесие. Скрытые действия и контракты (moral hazard, «безответственное поведение»). Скрытое знание. Отрицательный отбор. Скрининг. Проблемы принципала-агента.

Тема 5. Элементы стохастического программирования

Многопериодные процессы и повторяющиеся игры. Достоверность угроз и обещаний. Репутация. Однопериодные и многопериодные процессы принятия решений в условиях неопределенности. Двухэтапное программирование. Скользящее планирование.

Тема 6. Принятие решений по прецедентам

Понятие прецедента. Байесовский подход к принятию решений. Принятие решений в условиях ограниченной информации. Прогнозирование последствий принятых решений в изменяющейся среде

Контактные часы: 64

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

Методы текущего контроля: опрос, контрольная работа

Промежуточная аттестация: экзамен

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ОПК ОС-4.1	способен обосновывать организационно управленческие решения в профессиональной деятельности	демонстрирует умение формулировать задачи принятия решений в условиях неопределенности, может находить оптимальные решения при наличии риска
ОПК ОС-4.2	способен нести ответственность в отношении принимаемых решений	демонстрирует знание принципов многопериодных процессов, умение прогнозировать последствия принятых решений

Основная литература:

1. Гильбоа И. Как принять наилучшее решение? Теория принятия решений на практике / И. Гильбоа; пер. с англ. Н. Шиловой, под науч. ред. М. И. Левина, В. П. Бусыгина ; РАНХиГС при Президенте РФ. - Москва : Дело, 2017. - 287 с.
2. Джейли Дж. А., Рени Ф. Дж. Микроэкономика. Продвинутый уровень. Пер. с англ. под науч. ред. В. П. Бусыгина, М. И. Левина, Е. В. Покатович. - М. : ГУ ВШЭ, 2011. - 733 с.
3. Шведов А. С. Теория вероятностей и математическая статистика : учебное пособие для вузов / А. С. Шведов. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ГУ ВШЭ, 2005. - 254 с.
4. Юдин Д. Б. Экстремальные модели в экономике / Д. Б. Юдин, А. Д. Юдин. - Изд. 2-е, доп. - Москва : ЛИБРОКОМ, 2010. - 312 с.