

Министерство образования и науки

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования

Томский государственный университет систем управления  
и радиоэлектроники (ТУСУР)

Факультет систем управления  
Кафедра автоматизированных систем управления

**А.А. МИЦЕЛЬ**

**МАТЕМАТИЧЕСКОЕ И ИМИТАЦИОННОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ  
ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ**

Методические указания по самостоятельной работе студентов

Уровень основной образовательной программы бакалавриат

Специальность – Прикладная информатика 09.03.03

Профиль – Прикладная информатика в экономике

Томск-2016

**Мицель А.А.**

Математическое и имитационное моделирование экономических процессов. Методические указания по самостоятельной работе студентов по направлению 09.03.03 – «Прикладная информатика» (профиль прикладная информатика в экономике) / А.А. Мицель. – Томск: ТУСУР, 2016. – 12 с.

Методические указания разработаны в соответствии с решением кафедры автоматизированных систем управления

Составитель: профессор А.А. Мицель

Методические указания утверждены на заседании кафедры автоматизированных систем управления 12 февраля 2016 г., протокол № 6

© ТУСУР, каф. АСУ

© Мицель А.А.

**СОДЕРЖАНИЕ**

1. Цели и задачи дисциплины	4
2. Место дисциплины в структуру ООП	4
3. Требования к результатам освоения дисциплины	5
4. Содержание дисциплины	6
4.1 Теоретический материал	6
4.2 Лабораторные занятия	9
5. Темы для самостоятельного изучения	9
6. Методические рекомендации по самостоятельному изучению материала	9
7. Формы контроля	10
8. Интерактивные формы	10
9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	10

## 1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Математическое и имитационное моделирование экономических процессов» (МИМЭП) читается в 7 – 8 семестрах и предусматривает чтение лекций, проведение лабораторных занятий, получение различного рода консультаций.

**Целью дисциплины** Целью изучения дисциплины является теоретическая и практическая подготовка студентов по основам анализа и синтеза производственных и экономических процессов, структур систем и их отдельных подсистем, систем управления, систем поддержки принятия решений, усвоение экономико – математических моделей и приобретение навыков моделирования экономических процессов, применения методов финансовых вычислений, усвоение знаний по разработке имитационных моделей экономических процессов и объектов, приобретение навыков имитационного моделирования экономических процессов.

**Основными задачами** изучения дисциплины являются:

- подготовка студентов для практической и научной деятельности в области разработки моделей сложных систем и проведения на них исследований;
- анализ экономических объектов и процессов;
- экономическое прогнозирование, предвидение развития экономических процессов;
- формирование у студентов навыков, необходимых для выработки управленческих решений;
- изучение процессов массового обслуживания;
- имитация работы экономического объекта в трех измерениях: материальном, денежном и информационном;
- формирование у студентов навыков, необходимых для выработки управленческих решений.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Дисциплина «Математическое и имитационное моделирование экономических процессов» (МИМЭП) относится к числу дисциплин вариативной части математического и естественнонаучного цикла (Б2.В.ОД.2). К моменту изучения данной дисциплины студенты должны изучить курсы: математику, дискретную математику, численные методы, теорию вероятностей и математическую статистику, эконометрику, бухгалтерский учет. В качестве входных знаний студенты должны владеть фундаментальными понятиями математического анализа, линейной алгебры, математической статистики, эконометрического моделирования.

Освоение этой дисциплины необходимо для подготовки бакалавров к производственной деятельности и научным исследованиям в области прикладной информатики.

### 3. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Процесс изучения дисциплины «Математическое и имитационное моделирование экономических процессов» направлен на формирование следующих компетенций:

#### ***общекультурные компетенции (ОК):***

- способен использовать, обобщать и анализировать информацию, ставить цели и находить пути их достижения в условиях формирования и развития информационного общества (ОК-1);
- способен логически верно, аргументировано и ясно строить устную и письменную речь, владеть навыками ведения дискуссии и полемики (ОК-2);
- способен самостоятельно приобретать и использовать в практической деятельности
- новые знания и умения, стремиться к саморазвитию (ОК-5).

#### ***профессиональные компетенции (ПК):***

- способен при решении профессиональных задач анализировать социально-экономические проблемы и процессы с применением методов системного анализа и математического моделирования (ПК-2);
- способен ставить и решать прикладные задачи с использованием современных информационно-коммуникационных технологий (ПК-4);
- способен применять к решению прикладных задач базовые алгоритмы обработки информации, выполнять оценку сложности алгоритмов, программировать и тестировать программы (ПК-10);
- способен оценивать и выбирать современные операционные среды и информационно-коммуникационные технологии для информатизации и автоматизации решения прикладных задач и создания ИС (ПК-16);
- научно-исследовательская деятельность: способен применять системный подход и математические методы в формализации решения прикладных задач (ПК-21).

#### ***профессионально-специальные компетенции (ПСК):***

- способен анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчётах предприятий различных форм собственности и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений (ПСК-2).

**В результате изучения дисциплины студент должен:**

#### ***Знать:***

- классификацию видов математического моделирования;
- основные принципы и модели экономических процессов, методы их расчетов и уметь их использовать для планирования функционирования и развития предприятия;
- количественные методы анализа финансовых операций
- различные виды распределений (равномерное, биномиальное, нормальное, пуассоновское);
- алгоритмы моделирования случайных процессов;
- как получить ответ на вопрос «что будет, если...»;

**Уметь:**

- строить модели экономических систем и объектов;
- проводить финансовые расчеты
- генерировать непрерывные случайные величины различными методами (обратной функции, суперпозиции, исключения);
- применять макроэкономические и микроэкономические модели
- самостоятельно творчески использовать теоретические знания на практике, а также в процессе последующего обучения.

**Владеть:**

- методами моделирования;
- основными принципами построения имитационных моделей экономических процессов, методами их расчетов;
- навыками использования имитационных моделей для планирования функционирования и развития предприятия;
- навыками решения задач количественного анализа финансовых операций

**4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ****4.1 Теоретический материал****МОДУЛЬ 1 (7 семестр) «Моделирование экономических процессов»**

<b>Тема 1.</b> Основные понятия экономико-математического моделирования	Краткий исторический обзор. Экономико-математические методы и моделирование экономических процессов. Этапы экономического моделирования. Классификация экономико-математических методов и моделей.
<b>Тема 2.</b> Модели производства	Производственные функции. Понятие производственной функции одной переменной. Производственная функция нескольких переменных. Свойства производственных функций. Характеристики производственной функции. Задача производителя. Учет налогов. Функции спроса на ресурсы. Модели ценообразования.
<b>Тема 3.</b> Функции полезности	Множество благ. Функция полезности и ее свойства. Предельная полезность и предельная норма замещения благ. Оптимальный выбор благ потребителем
<b>Тема 4.</b> Балансовые модели	Балансовый метод. Принципиальная схема межотраслевого баланса. Экономико-математическая модель межотраслевого баланса. Коэффициенты прямых и полных материальных затрат. Агрегирование показателей межотраслевого баланса. Модель затрат труда. Модель фондоемкости продукции. Динамическая модель

<p><b>Тема 5.</b> Моделирование финансовых операций</p>	<p>Наращение и дисконтирование. Проценты и процентные ставки. <i>Наращение по простым процентам. Сложные проценты. Номинальная и эффективная ставки процентов. Понятие дисконтирования. Учет инфляции при наращении процентов. Эквивалентность простых и сложных процентных ставок. Наращение по учетной ставке. Сравнение методов наращивания. Сравнение методов дисконтирования.</i></p> <p>Потоки платежей, ренты. <i>Основные определения. Наращенная сумма потока платежей. Наращенная сумма годовой ренты с начислением процентов <math>m</math> раз в год. Наращенная сумма <math>P</math> – срочной ренты. Наращенная сумма <math>P</math> – срочной ренты при начислении процентов <math>m</math> раз в год. Современная величина потока платежей Современная величина годовой ренты Современная величина годовой ренты с начислением процентов <math>m</math> раз в год Современная величина <math>P</math> – срочной ренты (<math>m=1</math>) Современная величина <math>P</math> – срочной ренты при начислении процентов <math>m</math> раз в год</i></p> <p>Соотношение между наращенной и современной величинами ренты</p>
<p><b>Тема 6.</b> Доходность финансовой операции</p>	<p>Различные виды доходности операций. Учет налогов и инфляции. Поток платежей и его доходность. Мгновенная доходность</p>
<p><b>Тема 7.</b> Кредитные расчеты</p>	<p>Показатель полной доходности финансово-кредитной операции. Баланс финансово-кредитной операции. Определение полной доходности ссудных операций с удержанием комиссионных. Методы сравнения и анализа коммерческих контрактов. Планирование погашения долгосрочной задолженности</p>

## **МОДУЛЬ 2 (8 СЕМЕСТР) «ИМИТАЦИОННОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ»**

<p><b>Тема 8.</b> Математическое и компьютерное моделирование</p>	<p>Классификация видов моделирования/ Достоинства и недостатки имитационного моделирования. Типовые задачи имитационного моделирования. Социально-экономические процессы как объекты моделирования. Примеры задач имитационного моделирования</p>
<p><b>Тема 9.</b> Сущность метода</p>	<p>Метод имитационного моделирования и его особенности. Статическое и динамическое</p>

имитационного моделирования	представление моделируемой системы. Процесс имитации. Основные этапы процесса имитации. Определение системы. Постановка задачи. Формулирование модели. Оценка адекватности модели. Экспериментирование с использованием имитационной модели. Понятие о модельном времени. Механизм продвижения модельного времени. Интерпретация и реализация результатов моделирования. Организационные аспекты имитационного моделирования
<b>Тема 10.</b> Имитационные модели глобальных систем	Основные компоненты динамической мировой модели. Концепция «петля обратной связи». Основные петли «обратных связей» в мировой модели. Основные переменные в мировой модели. Структура модели мировой системы. Основные результаты экспериментов на модели мировой системы
<b>Тема 11.</b> Метод Монте-Карло и проверка статистических Гипотез	Методы проверки статистических гипотез. Критерии согласия $\chi^2$ ((хи-квадрат), Крамера-фон Мизеса, Колмогорова-Смирнова.
<b>Тема 12.</b> Моделирование случайных событий	Моделирование простого события. Моделирование дискретной случайной величины. Моделирование непрерывных случайных величин. <i>Метод обратной функции. Моделирование случайных величин с показательным распределением. Моделирование случайных величин с равномерным распределением на произвольном интервале <math>(a, b)</math>. Моделирование случайных величин с нормальным распределением. Моделирование случайных величин с усеченным нормальным распределением. Моделирование случайных величин с произвольным распределением</i>
<b>Тема 13.</b> Системы массового обслуживания	Основные понятия. Классификация СМО. Понятие марковского случайного процесса. Потоки событий. Уравнения Колмогорова. Предельные вероятности состояний. Процесс гибели и размножения. СМО с отказами. СМО с ожиданием (очередью)
<b>Тема 14.</b> Модели управления запасами	Основные понятия. Статическая детерминированная модель без дефицита. Статическая детерминированная модель с дефицитом. Стохастические модели управления запасами. Стохастические модели управления запасами с фиксированным



	временем задержки поставок
--	----------------------------

## 4.2. Лабораторные занятия

### Темы лабораторных работ

1. Модели производства
2. Функции полезности
3. Балансовые модели
4. Потоки платежей, ренты
5. Доходность финансовой операции
6. Кредитные расчеты
7. Генераторы случайных величин с равномерным распределением
8. Генерация случайных чисел с заданным законом распределения
9. Метод статистических испытаний Монте-Карло
10. Биржевой игрок
11. Способы построения моделирующих алгоритмов
12. Моделирование процессов обслуживания заявок в условиях отказов
13. Производственная модель управления запасами
14. Конкурсное распределение средств

## 5. ТЕМЫ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОГО ИЗУЧЕНИЯ

- 1) Алгоритмы генераторов случайных чисел.
- 2) Способы представления случайных данных.
- 3) Ипотечные кредиты.
- 4) Электронные торги.

## 6. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО САМОСТОЯТЕЛЬНОМУ ИЗУЧЕНИЮ МАТЕРИАЛА

Лекционный материал студенты должны просматривать регулярно, перед очередной лекцией. Контроль знаний проводится во время семинаров и контрольных работ.

Для выполнения лабораторных работ студенты должны изучить необходимый теоретический материал, который затем представляется в отчетах по лабораторным работам.

Указанные в п. 4 темы изучаются студентами самостоятельно. Литература по этим темам дана в п. 8.1, 8.2. Контроль знаний по этим темам осуществляется на лабораторных занятиях, а также во время контрольной точки и на экзамене.

## **7. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ**

Формой контроля освоения компетенций, указанных в п. 2, являются конспекты лекционного материала и самостоятельной работы, отчеты по лабораторным работам, контрольные работы, тесты, опросы на семинарских занятиях и экзамен.

## **8. ИНТЕРАКТИВНЫЕ ФОРМЫ**

Важным элементом успешного освоения материала являются интерактивные формы проведения занятий. По данной дисциплине предполагаются следующие интерактивные формы: работа в команде, поисковый метод и решение ситуационных задач.

1) «Работа в команде» происходит при коллективном выполнении заданий всех лабораторных работ.

2) «Поисковый метод» студенты используют при выполнении заданий (лаб. работа № 1.7, 2.7).

3) Решение ситуационных задач. Различные ситуационные моменты предлагаются студентам во время лекций, а также при выполнении лабораторных заданий.

## **9. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **9.1. основная литература**

1. Емельянов А.А. Имитационное моделирование экономических процессов: учебное пособие/А.А. Емельянов, Е.А. Власова, Р.В. Дума; под ред. А.А. Емельянова. – М.: Финансы и статистика; ИНФРА-М, 2009. – 416с. (электр. библ. «Лань»; режим доступа: (<http://e.lanbook.com/view/book/1025/>))

2. Мельников А.В., Попова Н.В., Скорнякова В.С. Математические методы финансового анализа: Учебное пособие /под ред. А.В. Мельникова. – Часть 1. Финансовый анализ в условиях определенности /Попова Н.В. (электр. ресурс). – Режим доступа: <http://ecsocman.edu.ru/db/msg/110004>

3. Забудский Г.Г. Математическое моделирование экономики: учебное пособие. – Омск.: ОмскГУ, 2008. –91с. (электр. библ. «Лань»; режим доступа: ([http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=12778](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=12778)))

Мицель А.А., Ефремова Е.А. Математическая экономика. Учебное пособие. – Томск: изд-во ТМЦ ДО, 2007. – 158с. (20 экз.)

### **9.2. дополнительная литература**

1. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Имитационное моделирование экономических процессов. Учебное пособие. Томск: Изд-во ТМЦ ДО, 2007. – 143с. (13 экз.)
2. Мицель А.А. Математическая экономика. Учебное пособие. Раздел 1. – Томск: Изд-во ТМЦ ДО, 2005. – 155с. (5 экз)
3. Мицель А.А. Математическая экономика. Учебное пособие. Раздел 2. – Томск: Изд-во ТМЦ ДО, 2005. – 174с. (6 экз)
4. Мицель А.А. Математическая экономика. Лабораторный практикум. – Томск: Изд-во НТЛ, 2006. – 184 с. (65 экз)
5. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Имитационное моделирование экономических объектов. Лабораторный практикум. (с грифом СибРУМЦ)– Томск: Изд-во НТЛ, 2005. – 160с.
6. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Сборник задач по имитационному моделированию экономических процессов. – Томск: изд-во ТУСУР, 2007. –174с. (50 экз.)
7. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Имитационное моделирование экономических процессов. Часть 1. Теоретические основы имитационного моделирования экономических процессов. Учебное пособие. Томск: Изд-во ТМЦ ДО, 2005. – 137с. (2 экз)
8. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Имитационное моделирование экономических процессов. Часть 2. Алгоритмические модели экономических систем. Учебное пособие. Томск: Изд-во ТМЦ ДО, 2005. – 99с. (3 экз)
9. Кундышева Е.С. Математическое моделирование в экономике : учебное пособие / Е. С. Кундышева ; ред. Б. А. Суслаков. - 2-е изд., перераб. и испр. - М. : Дашков и К°, 2006. - 349 с. (1 экз)  
Бережная Е.В., Бережной В.И. Математические методы моделирования экономических систем. — М.:Финансы и статистика, 2002. – 368с. (7 экз)

### **9.3. Перечень пособий, методических указаний и материалов, используемых в учебном процессе**

1. Мицель А.А., Грибанова Е.Б. Имитационное моделирование экономических процессов в Excel. – Томск: ТУСУР, 2014. –115с. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа:  
[http://asu.tusur.ru/learning/bak230700/d24/b230700\\_d24\\_lect.doc](http://asu.tusur.ru/learning/bak230700/d24/b230700_d24_lect.doc)
2. Мицель А.А. Математическое и имитационное моделирование экономических процессов в Mathcad. – Томск: Изд-во ТУСУР, 2014. –141с. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа:  
[http://asu.tusur.ru/learning/bak230700/d24/b230700\\_d24\\_labs.doc](http://asu.tusur.ru/learning/bak230700/d24/b230700_d24_labs.doc)

### **9.4. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы**

1. [www.osp.ru](http://www.osp.ru) – Издательство «Открытые системы»
2. <http://poiskknig.ru> – электронная библиотека учебников Мех-Мата МГУ, Москва
3. <http://www.mathnet.ru.ru/> - общероссийский математический портал

4. <http://www.lib.mexmat.ru> – электронная библиотека механико-математического факультета Московского государственного университета
5. <http://onlinelibrary.wiley.com> - научные журналы издательства Wiley&Sons
6. <http://www.sciencedirect.com/> - научные журналы издательства Elsevier

#### ***9.5. Лицензионное программное обеспечение***

- Операционная система MS Windows
- Офисный пакет Microsoft Office
- Пакет Mathsoft MathCAD
- Пакет Mathsoft Excel