

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РЯЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ С.А. ЕСЕНИНА»

Утверждаю:
Декан факультета экономики



В.С. Отто

«31» августа 2020 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Финансовое моделирование

Уровень основной профессиональной образовательной программы:

магистратура

Направление подготовки:

38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) подготовки

Бухгалтерский учет и бизнес-аналитика

Форма обучения:

заочная

Сроки освоения ОПОП:

нормативный, 2,5 года

Факультет: *экономики*

Кафедра:

экономики и финансов

Рязань, 2020

ВВОДНАЯ ЧАСТЬ

1. Цели освоения учебной дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины «Финансовое моделирование» является формирование у магистрантов профессиональных компетенций в области практического применения методов количественного анализа для принятия управленческих решений в финансовой сфере.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП магистратуры

2.1 Учебная дисциплина «Финансовое моделирование» относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1.

2.2 Для изучения данной учебной дисциплины необходимы следующие предшествующие дисциплины

- Экономический анализ и планирование хозяйственной деятельности фирмы;
- Прикладной статистический анализ;
- Анализ данных.

2.3 Знания, умения и навыки, формируемые данной учебной дисциплиной необходимы для успешного прохождения

- Государственной итоговой аттестация.

2.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОПОП

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных (ПК) компетенций:

№ п/п	Номер компетенции	Содержание компетенции	В результате прохождения практики обучающиеся должны		
			Знать	Уметь	Владеть
3.	ПК-8	способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	Основы и методы количественного анализа	Применять методы количественного анализа в процессе принятия финансовых решений как на микро, так и на макро уровнях	Навыками подготовки аналитических материалов для финансово-экономического обоснования принимаемых решений
4.	ПК-10	Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Основы финансового моделирования и область его эффективного применения	Строить модели внутрифирменных процессов в целях повышения эффективности управления	Навыками прогнозирования финансовых показателей предприятия на основе построения имитационных моделей

2.5 Карта компетенций дисциплины

КАРТА КОМПЕТЕНЦИЙ ДИСЦИПЛИНЫ				
НАИМЕНОВАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ – «ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ»				
ЦЕЛЬ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ - формирование у магистрантов профессиональных компетенций в области практического применения методов количественного анализа для принятия управленческих решений в финансовой сфере.				
В процессе освоения данной дисциплины студент формирует и демонстрирует следующие				
Общекультурные компетенции				
КОМПЕТЕНЦИИ	Перечень компонентов	Технологии формирования	Форма оценочного средства	Уровни освоения компетенций

ИНДЕКС	ФОРМУЛИРОВКА				
Профессиональные компетенции					
ПК-8	способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	Знать: основы и методы количественного анализа Уметь: применять методы количественного анализа в процессе принятия финансовых решений как на микро, так и на макро уровнях Владеть: навыками подготовки аналитических материалов для финансово-экономического обоснования принимаемых решений	Самостоятельная работа. Лекции Практические занятия.	Зачет	ПОРОГОВЫЙ – обладает необходимыми знаниями в области имеющихся количественных методов анализа и моделирования ПОВЫШЕННЫЙ – способен на основе имеющихся знаний принимать взвешенные решения в финансовой сфере
ПК-10	Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Знать: основы финансового моделирования и область его эффективного применения Уметь: строить модели внутрифирменных процессов в целях повышения эффективности управления Владеть: навыками прогнозирования финансовых показателей предприятия на основе построения имитационных моделей	Самостоятельная работа. Лекции Практические занятия.	Зачет	ПОРОГОВЫЙ – обладает необходимыми знаниями о построении финансовых моделей ПОВЫШЕННЫЙ – способен на основе имеющихся глубоких знаний о методах моделирования строить прогнозы финансово-экономических показателей деятельности предприятия

ОСНОВНАЯ ЧАСТЬ

1. Объем учебной дисциплины и виды учебной работы

Виды учебной работы	Всего часов	Семестр
		3/2 часы
Контактная работа обучающихся с преподавателем (всего)	16	16
В том числе:		
Лекции (Л)	4	4
Практические занятия (ПЗ)	12	12
Лабораторные работы (ЛР)		
Самостоятельная работа магистранта (всего)	88	88
В том числе		
СРМ в семестре	88	88
Выполнение заданий при подготовке к семинарским занятиям	34	34
Подготовка к устному собеседованию по теоретическим разделам	18	18
Изучение литературы по темам занятий	36	36
СРМ в период сессии		
Вид промежуточной аттестации - зачет	4	4
ИТОГО: общая трудоемкость	часов	108
	зач.ед.	3

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (Moodle, Zoom).

2. Содержание учебной дисциплины

2.1. Содержание разделов учебной дисциплины

№ курса	№ раздела	Наименование раздела учебной дисциплины	Содержание раздела в дидактических единицах
3	1	Моделирование анализа долгосрочных финансовых операций	<p>Сущность и этапы финансового моделирования. Информационное обеспечение финансовых решений. Программное обеспечение финансовых решений</p> <p>Фактор времени и оценка поток и платежей.</p> <p>Принцип временной ценности денег. Методы учет фактора времени в финансовых операциях. Оценка потоков платежей. Разработка планов погашения кредита.</p> <p>Анализ инвестиционных проектов</p> <p>Метод чистой современной стоимости. Внутренняя норма доходности. Индекс рентабельности проекта.</p> <p>Методы оптимизации в инвестиционном анализе.</p> <p>Анализ и моделирование лизинговых операций.</p> <p>Виды лизинговых соглашений. Позиция арендатора.</p>

			Позиция владельца.
3	2	Моделирование оценки финансовых рисков	<p>Природа риска и показатели его измерения. Случайные события. Вероятности. Законы распределения. Автоматизация расчетов показателей рисков.</p> <p>Методы анализа рисков инвестиционных проектов. Метод корректировки нормы дисконта. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев. Анализ вероятности распределения потоков платежей. Деревья решений. Имитационное моделирование рисков.</p> <p>Моделирование рисков инвестиционных проектов. Технология имитационного моделирования в среде MS EXCEL.</p> <p>Теория портфеля и модели оценки рисков активов.</p> <p>Этапы формирования инвестиционного портфеля. Оценка риска и доходности портфеля. Модели ценообразования активов на рынке капиталов.</p>
3	3	Моделирование анализа ценных бумаг с фиксированным доходом	<p>Долгосрочные инструменты с фиксированным доходом.</p> <p>Виды облигаций и их характеристики. Методы оценки облигаций с периодическим доходом. Оценка бескупонных облигаций. Бессрочные облигации. Ценные бумаги с выплатой процентов в момент погашения.</p> <p>Краткосрочные и коммерческие ценные бумаги. Фактор времени в краткосрочных финансовых операциях. Анализ краткосрочных бескупонных облигаций. Краткосрочные бумаги с выплатой процентов в момент погашения. Анализ операций с векселями. Краткосрочные разовые ссуды и депозиты.</p>

2.2. Разделы учебной дисциплины, виды учебной деятельности и формы контроля

№ курса	№ раздела	Наименование раздела учебной дисциплины	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу магистрантов (в часах)				
			Л	ЛР	ПЗ	СРМ	всего
3	1	Моделирование анализа долгосрочных финансовых операций	2	-	4	28	34
3	2	Моделирование оценки финансовых рисков	1	-	4	30	35
3	3.	Моделирование анализа ценных бумаг с фиксированным доходом	1	-	4	30	35
		ИТОГО за курс	4	-	12	88	104
		Контроль					4
		ИТОГО					108

2.3 Лабораторный практикум.

Не предусмотрен.

2.4 Примерная тематика курсовых работ

Курсовая работа не предусмотрена

3. Самостоятельная работа магистранта

3.1. Виды СРМ

№ курса	№ раздела	Наименование раздела учебной дисциплины	Виды СРМ	Всего часов
3	1	Моделирование анализа долгосрочных финансовых операций	Выполнение заданий при подготовке к семинарским занятиям.	10
			Подготовка к устному собеседованию по теоретическим разделам.	6
			Изучение литературы по темам занятий.	12
3	2	Моделирование оценки финансовых рисков	Выполнение заданий при подготовке к семинарским занятиям.	12
			Подготовка к устному собеседованию по теоретическим разделам.	6
			Изучение литературы по темам занятий.	12
3	3	Моделирование анализа ценных бумаг с фиксированным доходом	Выполнение заданий при подготовке к семинарским занятиям.	12
			Подготовка к устному собеседованию по теоретическим разделам.	6
			Изучение литературы по темам занятий.	12
ИТОГО за курс				88

3.2. График работы магистранта заполняется только для очной формы обучения

3.3 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине.

Самостоятельная работа, наряду с аудиторными занятиями, является неотъемлемой частью изучения дисциплины «Финансовое моделирование».

Приступая к изучению дисциплины, магистранты должны ознакомиться с учебной программой, учебной, научной и методической литературой, имеющейся в библиотеке, получить в библиотеке рекомендованные учебники и учебно-методические пособия, завести тетради для конспектирования лекций и практических занятий.

В ходе самостоятельной работы изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, научными статьями и материалы исследований в данной области. При этом учесть рекомендации преподавателя и требования учебной программы.

При подготовке к зачету повторять пройденный материал в строгом соответствии с учебной программой, примерным перечнем учебных вопросов, выносящихся на зачет и содержащихся в данной программе. Использовать конспект лекций и литературу, рекомендованную преподавателем. Обратить особое внимание на темы учебных занятий, пропущенных студентом по разным причинам. При необходимости обратиться за консультацией и методической помощью к преподавателю.

В процесс освоения дисциплины включаются два вида самостоятельной работы:

- аудиторная;
- внеаудиторная.

Аудиторная самостоятельная работа по дисциплине выполняется на учебных занятиях под непосредственным руководством преподавателя и по его заданию.

Внеаудиторная самостоятельная работа выполняется студентом по заданию преподавателя, но без его непосредственного участия.

Содержание внеаудиторной самостоятельной работы определяется в соответствии с рекомендуемыми видами заданий согласно рабочей программе учебной дисциплины.

Видами заданий для внеаудиторной самостоятельной работы являются:

- для овладения знаниями: чтение текста (учебника, дополнительной литературы, нормативных документов), составление плана текста, конспектирование текста, выписки из текста, учебно-исследовательская работа, использование аудио- и видеозаписей, компьютерной техники и Интернета и др.

- для закрепления и систематизации знаний: работа с конспектом лекции, обработка текста, повторная работа над учебным материалом, (составление плана, составление таблиц для систематизации учебного материала, ответ на контрольные вопросы, заполнение рабочей тетради, аналитическая обработка текста), подготовка мультимедиа сообщений/докладов к выступлению на семинаре, подготовка реферата, тестирование и др.

- для формирования умений: решение практических ситуационных задач, решение тестов и т.д.

Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами магистрантов в зависимости от цели, объема, конкретной тематики самостоятельной работы, уровня сложности, уровня умений магистрантов.

Контроль результатов внеаудиторной самостоятельной работы магистрантов может осуществляться в пределах времени, отведенного на обязательные учебные занятия по дисциплине и внеаудиторную самостоятельную работу магистрантов по дисциплине, может проходить в письменной, устной или смешанной форме.

Для оптимизации организации и повышения качества обучения магистрантам рекомендуется руководствоваться следующими методическими рекомендациями, размещёнными на официальном сайте:

1. Мартишина Н.В. Электронный образовательный ресурс «Самостоятельная работа магистрантов»: свидетельство о регистрации ресурса № 20418 / Мартишина Н.В., Еремкина О.В.; Ряз. гос. ун-т им. С.А. Есенина. – Дата регистрации 21.10.2014. – Объем 196 Мб (200704 Кб).

2. Мишакова Н. А., Истомина Т. И., Енькова М. О. Организация самостоятельной работы магистрантов. Методические рекомендации для преподавателей и магистрантов. - Редакционно-издательский центр РГУ имени С. А. Есенина, Рязань, 2014 г., - 40 с.

4. Оценочные средства для контроля успеваемости и результатов освоения учебной дисциплины (см. фонд оценочных средств)

4.1. Рейтинговая система оценки не используется.

5. Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины

5.1. Основная литература

№ п/п	Автор (ы), наименование, место издания и издательство, год	Используется при изучении разделов	Курс	Количество экземпляров	
				В библиотеке	На кафедре
1	2	3	4	5	6
1.	Лукаевич, И. Я. Финансовое моделирование в фирме : учебник для вузов / И. Я. Лукаевич. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 356 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-11944-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/446477 (дата обращения: 27.08.2020).	1-3	3	ЭБС	
2.	Жаров, Д. Финансовое моделирование в Excel : практическое пособие : [16+] / Д. Жаров ; ред. С. Кривошеин. – Москва : Альпина Паблицер, 2016. – 169 с. : табл., схем. – Режим доступа: по подписке. — URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=443014 (дата обращения: 27.08.2020). – ISBN 978-5-9614-0885-0. – Текст : электронный.	1-3	3	ЭБС	

5.2. Дополнительная литература

№ п/п	Автор (ы), наименование, место издания и издательство, год	Используется при изучении разделов	Курс	Количество экземпляров	
				В библиотеке	На кафедре
1	2	3	4	5	6
1.	Гармаш, А. Н. Экономико-математические	1-3	3	ЭБС	

	методы и прикладные модели : учебник для бакалавриата и магистратуры / А. Н. Гармаш, И. В. Орлова, В. В. Федосеев ; под редакцией В. В. Федосеева. — 4-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 328 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3698-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/406453 (дата обращения: 27.08.2020).				
2.	Жаров, Д. Финансовое моделирование в Excel : практическое пособие : [16+] / Д. Жаров ; ред. С. Кривошеин. — Москва : Альпина Паблишер, 2016. — 169 с. : табл., схем. — Режим доступа: по подписке. — URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=443014 (дата обращения: 27.08.2020). — ISBN 978-5-9614-0885-0. — Текст : электронный.	1-3	3	ЭБС	

5.3. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы:

1. КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: официальный сайт. — Режим доступа: <http://www.consultant.ru>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
2. Научная библиотека РГУ имени С. А. Есенина [Электронный ресурс]: сайт. — Режим доступа: <http://library.rsu.edu.ru>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
3. Университетская библиотека ONLINE [Электронный ресурс]: электронная библиотека. — Доступ к полным текстам по паролю. — Режим доступа: <http://biblioclub.ru/> (дата обращения: 27.08.2020).
4. Электронный каталог НБ РГУ имени С. А. Есенина [Электронный ресурс]: база данных содержит сведения о всех видах литературы, поступающих в фонд НБ РГУ имени С.А. Есенина. — Рязань, [1990 -]. — Режим доступа: <http://library.rsu.edu.ru/marc>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).

5.4. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сеть «Интернет»), необходимых для освоения дисциплины:

1. eLIBRARY.RU [Электронный ресурс]: научная электронная библиотека. — Режим доступа: <http://elibrary.ru/defaultx.asp>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
2. Библиотека успешного бизнесмена [Электронный ресурс]: сайт. — Режим доступа: <http://club-energy.ru/a.php>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
3. Мировая экономика: новости, статьи, статистика [Электронный ресурс]: сайт. — Режим доступа: <http://www.ereport.ru/>, свободный (дата обращения 27.08.2020).

4. Российская государственная библиотека [Электронный ресурс]: сайт. – Режим доступа: <https://www.rsl.ru/>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
5. Российский журнал менеджмента [Электронный ресурс]: сайт журнала. – Режим доступа: <https://www.rjm.ru/>, свободный (дата обращения 27.08.2020).
6. Справочник для экономистов [Электронный ресурс]: сайт. – Режим доступа: <http://www.catback.ru>, свободный (дата обращения 27.08.2020).
7. Федеральная служба государственной статистики [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.gks.ru/>, свободный (дата обращения 27.08.2020).
8. Международный Валютный Фонд [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.imf.org/external/russian/>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
9. Министерство финансов Российской Федерации [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <https://www.minfin.ru/ru/>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).
10. Центральный банк Российской Федерации [Электронный ресурс]: официальный сайт. – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/>, свободный (дата обращения: 27.08.2020).

6. Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины

- 6.1. Требования к аудиториям для проведения занятий:** стандартно оборудованные аудитории для проведения интерактивных занятий – видеопроектор, экран настенный.
- 6.2. Требования к оборудованию рабочих мест преподавателя и обучающихся:** видеопроектор, компьютер, интерактивная доска.
- 6.3. Требования к специализированному оборудованию:** отсутствуют.

7. Образовательные технологии (Заполняется только для стандарта ФГОС ВПО)

8. Методические указания для обучающихся по дисциплине

Вид учебных занятий	Организация деятельности магистранта
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы,

	термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Уделить внимание следующим понятиям (перечисление понятий) и др.
Практические занятия	Проработка рабочей программы дисциплины, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом (указать текст из источника и др.), прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, решение расчетно-графических заданий, решений задач по алгоритму и др.
Подготовка к зачету	При подготовке к зачету необходимо ориентироваться на конспекты лекций, рекомендуемую литературу и др.

9. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

1. Возможность консультирования обучающихся преподавателем посредством сети Интернет.
2. Проверка домашних заданий и консультирование посредством электронной почты.
3. Использование слайд-презентаций при проведении практических занятий.

10. Требования к программному обеспечению учебного процесса.

Стандартный набор ПО (в компьютерных классах):

Название ПО	№ лицензии
Операционная система WindowsPro	Договор №65/2019 от 02.10.2019
Антивирус Kaspersky Endpoint Security	Договор № 14-ЗК-2020 от 06.07.2020г.
Офисное приложение Libre Office	Свободно распространяемое ПО
Архиватор 7-zip	Свободно распространяемое ПО
Браузер изображений Fast Stone ImageViewer	Свободно распространяемое ПО
PDF ридер Foxit Reader	Свободно распространяемое ПО
Медиа проигрыватель VLC mediaplayer	Свободно распространяемое ПО
Запись дисков Image Burn	Свободно распространяемое ПО
DJVU браузер DjVuBrowser Plug-in	Свободно распространяемое ПО

Стандартный набор ПО (для кафедральных ноутбуков):

Название ПО	№ лицензии
-------------	------------

Операционная система Windows ¹	
Антивирус Kaspersky Endpoint Security	Договор № 14-ЗК-2020 от 06.07.2020г.
Офисное приложение Libre Office	Свободно распространяемое ПО
Архиватор 7-zip	Свободно распространяемое ПО
Браузер изображений Fast Stone ImageViewer	Свободно распространяемое ПО
PDF ридер Foxit Reader	Свободно распространяемое ПО
Медиа проигрыватель VLC mediaplayer	Свободно распространяемое ПО
Запись дисков Image Burn	Свободно распространяемое ПО
DJVU браузер DjVuBrowser Plug-in	Свободно распространяемое ПО

При реализации дисциплины с применением (частичным применением) дистанционных образовательных технологий используются:

- вебинарная платформа Zoom (договор б/н от 10.10.2020г.);
- система электронного обучения Moodle (свободно распространяемое ПО)

¹ Информация об операционной системе Windows, установленной на кафедральных ноутбуках, размещена на лицензионных наклейках на ноутбуках.

Приложение 1

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Паспорт фонда оценочных средств по дисциплине для промежуточного контроля успеваемости

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины (результаты по разделам)	Код контролируемой компетенции) или её части)	Наименование оценочного средства
1.	Моделирование анализа долгосрочных финансовых операций	ПК-9, ПК-10	зачет
2.	Моделирование оценки финансовых рисков	ПК-9, ПК-10	зачет
3.	Моделирование анализа ценных бумаг с фиксированным доходом	ПК-9, ПК-10	зачет

ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

Индекс компетенции	Содержание компетенции	Элементы компетенции	Индекс элемента
ПК-8	Способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	знать	
		З1 основы и методы количественного анализа	ПК8 З1
		уметь	
		У1 применять методы количественного анализа в процессе принятия финансовых решений как на микро, так и на макро уровнях	ПК8 У1
		владеть	
		В1 навыками подготовки аналитических материалов для обоснования принимаемых решений	ПК8 В1
ПК-10	Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	знать	
		З1 основы финансового моделирования и область его эффективного применения	ПК10 З1
		уметь	
		У1 строить модели внутрифирменных процессов в целях повышения эффективности управления	ПК10 У1
		владеть	
		В1 навыками прогнозирования финансовых показателей предприятия на основе построения имитационных моделей	ПК10 В1

КОМПЛЕКТ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
(ЗАЧЕТ)

№	Содержание оценочного средства	Индекс оцениваемой компетенции и ее элементов
1.	Сущность и этапы финансового моделирования.	ПК8 З1 ПК10 З1
2.	Информационное обеспечение финансовых решений.	ПК8 З1 ПК10 З1 ПК8 В1
3.	Программное обеспечение финансовых решений	ПК10 З1
4.	Принцип временной ценности денег.	ПК10 З1
5.	Методы учет фактора времени в финансовых операциях.	ПК8 У1
6.	Оценка потоков платежей.	ПК8 У1 ПК10 В1
7.	Разработка планов погашения кредита.	ПК8 У1 ПК10 В1
8.	Метод чистой современной стоимости.	ПК10 У1
9.	Внутренняя норма доходности.	ПК10 У1
10.	Индекс рентабельности проекта.	ПК10 У1
11.	Методы оптимизации в инвестиционном анализе.	ПК8 У1 ПК10 В1
12.	Виды лизинговых соглашений.	ПК10 У1
13.	Автоматизация расчетов показателей рисков.	ПК10 З1
14.	Метод корректировки нормы дисконта.	ПК8 У1
15.	Анализ чувствительности критериев эффективности.	ПК8 У1
16.	Метод сценариев.	ПК8 У1
17.	Анализ вероятности распределения потоков платежей.	ПК10 З1
18.	Моделирование рисков инвестиционных проектов.	ПК10 З1 ПК10 У1
19.	Технология имитационного моделирования в среде MS EXCEL.	ПК8 В1 ПК10 У1 ПК10 В1
20.	Этапы формирования инвестиционного портфеля.	ПК10 З1 ПК10 У1 ПК10 В1
21.	Оценка риска и доходности портфеля.	ПК8 У1 ПК10 У1
22.	Модели ценообразования активов на рынке капиталов.	ПК8 У1 ПК10 У1
23.	Методы оценки облигаций с периодическим доходом..	ПК8 У1
24.	Оценка бескупонных облигаций.	ПК8 У1
25.	Бессрочные облигации.	ПК8 У1
26.	Ценные бумаги с выплатой процентов в момент погашения	ПК8 У1
27.	Фактор времени в краткосрочных финансовых операциях.	ПК8 У1
28.	Анализ краткосрочных бескупонных облигаций.	ПК8 У1
29.	Краткосрочные бумаги с выплатой процентов в момент погашения.	ПК8 У1
30.	Анализ операций с векселями.	ПК8 У1

ПОКАЗАТЕЛИ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ (Шкалы оценивания)

Зачет

Результаты выполнения обучающимся заданий на зачете оцениваются по шкале «зачтено» - «не зачтено».

В основе оценивания лежат критерии порогового и повышенного уровня характеристик компетенций или их составляющих частей, формируемых на учебных занятиях по дисциплине «Финансовое моделирование» (Таблица 2.5 рабочей программы дисциплины).

«Зачтено» - оценка соответствует повышенному уровню и выставляется обучающемуся, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос или выполнении заданий, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.

«Не зачтено» - оценка выставляется обучающемуся, который не достигает порогового уровня, демонстрирует непонимание проблемы, не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы.

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**

«Рязанский государственный университет имени С.А. Есенина»

Утверждаю:
Декан факультета экономики



В.С. Отто

«31» августа 2020 г.

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
«ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ»**

Направление подготовки
38.04.01 «Экономика»

Направленность (профиль)
«Бухгалтерский учет и бизнес-аналитика»

Квалификация
магистр

Форма обучения
заочная

Рязань, 2020

1. Цель освоения дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины «Финансовое моделирование» является формирование у магистрантов профессиональных компетенций в области практического применения методов количественного анализа для принятия управленческих решений в финансовой сфере.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина относится к вариативной части Блока 1.

Дисциплина изучается на 3 курсе (в 3/2 семестре)

3. Трудоемкость дисциплины: 3 зачетных единицы, 108 академических часов.

4. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

№ п/п	Номер компетенции	Содержание компетенции	В результате прохождения практики обучающиеся должны		
			Знать	Уметь	Владеть
3.	ПК-8	способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	Основы и методы количественного анализа	Применять методы количественного анализа в процессе принятия финансовых решений как на микро, так и на макро уровнях	Навыками подготовки аналитических материалов для финансово-экономического обоснования принимаемых решений
4.	ПК-10	Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Основы финансового моделирования и область его эффективного применения	Строить модели внутрифирменных процессов в целях повышения эффективности управления	Навыками прогнозирования финансовых показателей предприятия на основе построения имитационных моделей

5. Форма промежуточной аттестации и семестр прохождения

Зачет (3/2 семестр)

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных технологий.