Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 19.11.2026 19:20:12
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

КАФЕДРА ФИНАНСОВ И ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебно-методической работе
_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)
«_26_» февраля 2025 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.04 ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫХ РЕШЕНИЙ

(шифр, название учебной дисциплины в соответствии с учебным планом)

Укрупненная группа направлений подготовки _38.00.00 Экономика и управление___

Программа высшего образования – программа магистратуры_____

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит_____

Магистерская программа Финансы и кредит_____

Институт учета и финансов_____

Форма обучения, курс:
очная форма обучения, 1 курс
заочная форма обучения, 1 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2025

Рабочая программа учебной дисциплины «Финансовое моделирование инвестиционных решений» для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, Магистерской программе Финансы и кредит, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»:
– в 2025 г. – для очной формы обучения
– в 2025 г. – для заочной формы обучения

Разработчик: Нефёдова Юлия Витальевна, доцент кафедры финансов и экономической безопасности, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и экономической безопасности
Протокол от «12» 02. 2025 года № 21

Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности
_____ Л.А. Омельянович
(подпись)

СОГЛАСОВАНО
Директор института учета и финансов
_____ Л.И. Тымчина
(подпись)
«24» 02.2025 г.

ОДОБРЕНО
Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»
Протокол от «26» 02. 2025 года № 7

Председатель_____ Л.В. Крылова
(подпись)

© Нефёдова Ю.В., 2025 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2025 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки / специальностей, направление подготовки / специальность, профиль / магистерская программа / специализация, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика учебной дисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>заочная форма обучения</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Количество зачетных единиц – 3</td><td>Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление</td><td colspan="2" rowspan="2">Часть, формируемая участниками образовательных отношений</td></tr>
<tr><td>Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="5">Магистерская программа Финансы и кредит</td><td colspan="2">Год подготовки:</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 2</td><td>2-й</td><td>2-й</td></tr>
<tr><td rowspan="4">Общее количество часов – 108</td><td colspan="2">Семестр:</td></tr>
<tr><td>3-й</td><td>4-й</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td>18 час.</td><td>10 час.</td></tr>
<tr><td rowspan="10">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных – 4
самостоятельной работы обучающегося – 8</td><td rowspan="10">Программа высшего образования – программа магистратуры</td><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>18 час.</td><td>8 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные работы</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>44,1 час.</td><td>78,1 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания[1]</td></tr>
<tr><td>3 ТМК</td><td>3 ТМК (АПР)</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации</td></tr>
<tr><td>Экзамен</td><td>Экзамен</td></tr>
</table>

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 2ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

* для заочной формы обучения указывается, при наличии, аудиторная письменная работа/контрольная работа (АПР), курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения – 36 / 44,1;
для заочной формы обучения – 18 / 78,1.

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: сформировать у обучающихся целостные представления о теории и практике финансового моделирования инвестиционных решений. Выработать умения, навыки, профессиональную и гражданскую ответственность по принятию решений в сфере финансового моделирования инвестиционных решений. Сформировать у обучающихся знания о комплексном исследовании сущности, механизма и технологии финансового моделирования инвестиционных решений с использованием инструментария прикладных программных продуктов.

Задачи учебной дисциплины: формирование теоретических знаний в области основ принятия инвестиционных решений, финансового моделирования в инвестиционных проектах; раскрытие вопросов формирования направлений стратегического развития организации; определение вопросов разработки инвестиционных идей; принятия инвестиционных решений; исследование способов моделирования рисков инвестиционных проектов; формирование знаний, умений и навыков, связанных с выяснением подходов к разработке и оценке финансовой модели инвестиционного проекта; анализировать вопросы системы имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.04 «Финансовое моделирование инвестиционных решений» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений ОПОП ВО.

Связь с другими дисциплинами учебного плана:

- перечень действующих и предшествующих дисциплин: «Методология и методы научных исследований», «Актуальные проблемы финансов», «Финансы государственно-частного партнерства», «Корпоративные финансы»;
- перечень теоретических дисциплин и практик, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Финансовый менеджмент», «Корпоративные финансовые риски», «Корпоративная финансовая стратегия».

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения учебной дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-3 Способен разрабатывать финансовый план для клиента и целевой инвестиционный портфель	ИД-1ПК-3 Осуществляет моделирование целевого портфеля. ИД-2ПК-3 Составляет прогноз денежного потока.

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: основы финансового моделирования инвестиционных решений; содержание процесса стратегического управления инвестициями и ресурсами предприятия в процессе инвестирования; основные схемы финансирования инвестиционных проектов; методы оценки экономической эффективности инвестиционных проектов; современное программно-информационное обеспечение, необходимое для прогнозирования и решения экономических задач и регулирования денежных и финансовых потоков.

уметь: использовать современное программно-информационное обеспечение для решения финансово-экономических задач; сформировать инвестиционный бизнес-план действующего

предприятия, исходя из его первичных данных и целевых установок инвестиционной стратегии; использовать полученные результаты в сформированный инвестиционный проект; оценить полученные результаты посредством использования методов оценки эффективности инвестиционных проектов.

владеть: практическими навыками деятельности в профессиональной сфере; информационной базой финансового моделирования инвестиционных решений; разработкой стратегических целей развития предприятия; финансовым обеспечением процесса инвестирования; основами проведения анализа риска и достоверности инвестиционных проектов.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫХ РЕШЕНИЙ.

Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.

Тема 1. Основы принятия инвестиционных решений.

Тема 2. Финансовое моделирование в инвестиционных проектах.

Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации.

Тема 3. Разработка инвестиционных идей.

Тема 4. Анализ инвестиционных решений.

Тема 5. Моделирование рисков инвестиционных проектов.

Смысловой модуль 3. Разработка финансовой модели инвестиционного проекта.

Тема 6. Финансовое моделирование и оценка проектов.

Тема 7. Информационная модель бизнес-плана инвестиционного проекта.

Тема 8. Система имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта.

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Названия смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						заочная форма обучения					
	Всего	в том числе					Всего	в том числе				
		л[1]	п[2]	лаб[3]	инд[4]	СРС[5]		л	п	лаб	инд	СРС
1	*2*	*3*	*4*	*5*	*6*	*7*	*8*	*9*	*10*	*11*	*12*	*13*
МОДУЛЬ 1. ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫХ РЕШЕНИЙ.												
Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.												
Тема 1. Основы принятия инвестиционных решений.	9	2	2	-	-	5	11	1	1	-	-	9
Тема 2. Финансовое моделирование в инвестиционных проектах.	9	2	2	-	-	5	12	1	1	-	-	10
Всего по смысловому модулю 1	***18***	***4***	***4***	***-***	***-***	***10***	***23***	**2**	**2**	**-**	**-**	**19**
Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации.												
Тема 3. Разработка инвестиционных идей.	9	2	2	-	-	5	11	1	1	-	-	9
Тема 4 Анализ инвестиционных	9	2	2	-	-	5	12	1	1	-	-	10

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.			
1	**Тема 1.** Основы принятия инвестиционных решений.	2	1
2	**Тема 2.** Финансовое моделирование в инвестиционных проектах.	2	1
Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации.			
3	**Тема 3.** Разработка инвестиционных идей.	2	1
4	**Тема 4** Анализ инвестиционных решений.	2	1
5	**Тема 5.** Моделирование рисков инвестиционных проектов.	4	1
Смысловой модуль 3. Разработка финансовой модели инвестиционного проекта.			
6	**Тема 6.** Финансовое моделирование и оценка проектов.	2	1
7	**Тема 7.** Информационная модель бизнес-плана инвестиционного проекта.	2	1
8	**Тема 8.** Система имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта.	2	1
	ВСЕГО	**18**	**8**

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	*2*	*3*	*4*

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.			
1	**Тема 1.** Основы принятия инвестиционных решений.	5	9
2	**Тема 2.** Финансовое моделирование в инвестиционных проектах.	5	10
Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации.			
3	**Тема 3.** Разработка инвестиционных идей.	5	9
4	**Тема 4** Анализ инвестиционных решений.	5	10
5	**Тема 5.** Моделирование рисков инвестиционных проектов.	6	10
Смысловой модуль 3. Разработка финансовой модели инвестиционного проекта.			
6	**Тема 6.** Финансовое моделирование и оценка проектов.	6	10,1
7	**Тема 7.** Информационная модель бизнес-плана инвестиционного проекта.	6,1	10
8	**Тема 8.** Система имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта..	6	10
	ВСЕГО	**44,1**	**78,1**

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или заменяются устным ответом;

2) для глухих и слабослышащих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- зачет проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания заменяются устным ответом;
- зачет проводится в устной форме.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:

- в печатной форме увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа.

2) для глухих и слабослышащих:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

11. ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.

1. Экономическая сущность и виды инвестиций.
2. Особенности инвестиционных решений и их классификация.
3. Принципы, этапы, алгоритм принятия и осуществления инвестиционных решений.
4. Сущность и классификация финансовых моделей.
5. Принципы финансового моделирования.
6. Моделирование оценки инвестиционной привлекательности предприятия.
7. Инвестиционный анализ с использованием программных продуктов.

8. Содержание финансового управления инвестициями, его влияние на развитие предприятия.
9. Формирование стратегических направлений инвестирования на предприятиях.
10. Изменение притока инвестиций как основа роста инвестиционной активности.
11. Реализация стратегического финансового управления реальными инвестициями.
12. Финансовое управление инвестиционным портфелем.
13. Характеристика принципов финансового моделирования.
14. Особенности финансового моделирования оценки инвестиционной привлекательности предприятия.
15. Финансовое моделирование в *Project Expert.*

Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации

1. Инвестиционная идея как основа для принятия управленческих решений.
2. Формирование инвестиционного замысла (идеи) проекта.
3. Подход к обоснованию инвестиционной идеи «сверху-вниз».
4. Направление обоснования инвестиционной идеи «снизу-вверх».
5. Разработка экспертной системы инвестиционного проектирования.
6. Особенности построения экономико-математической простой линейной регрессионной модели.
7. Финансовое моделирование в Microsoft Excel.
8. Использование программы Project Expert в инвестиционном проектировании.
9. Фактор риска при оценке эффективности проектов.
10. Анализ сценариев.
11. Анализ безубыточности.
12. Анализ чувствительности.
13. Факторный анализ.
14. Метод Монте-Карло.
15. Экспертный анализ.
16. Инвестиционная идея как основа для принятия управленческих решений.
17. Исследование направлений финансового управления реальными инвестициями.
18. Инвестиционный анализ с использованием программных продуктов.
19. Влияние макроэкономических факторов на инвестиционные настроения и рыночную стоимость инвестиционных активов.
20. Финансово-экономическая среда планирования реализации инвестиционного проекта.
21. Количественная оценка экономического риска.
22. Фактор риска и неопределенности при оценке эффективности проектов.
23. Основы моделирования рисков инвестиционного проекта.
24. Методические основы минимизации инвестиционных рисков.

Задача

Инвестор планирует вкладывать средства в строительство жилого комплекса в сумме 1,5 млн. руб. в конце каждого года в течение 5 лет. Определить сумму, которую может получить инвестор ежегодно и через 5 лет, если процентная ставка равна 17%.

Расчет осуществить двумя методами: по формуле и по часовой линии.

Задача

Сумма первоначальных инвестиций предприятия составляет 800 тыс. руб. Проект рассчитан на 3 года. В первый год планируется получение убытка в размере 250 тыс. руб., а начиная со 2 года прибыли: 2 год – 400 тыс. руб., 3 год – 575 тыс. руб. Ставка дисконтирования составляет 18%. Рассчитать чистую приведенную стоимость инвестиций. Обосновать соответствующие выводы.

Задача

ООО «Аллюр» предусматривает инвестировать средства в приобретение новой техники. До

внедрения новой техники объем производства продукции высшего сорта составил 150 тыс. тонн, а первого – 270 тыс. тонн.

После внедрения новой техники предприятие предполагает увеличить выпуск продукции высшего сорта в 1,2 раза, а объем первого сорта оставить на базовом уровне. При этом цена продукции высшего сорта равна 450 руб. / тонн, а первого – 310 руб./тонн.

Необходимо сделать вывод о целесообразности инвестирования в новую технику на основании расчета планового прироста прибыли.

Смысловой модуль 3. Разработка финансовой модели инвестиционного проекта

1. Финансовое моделирование и его классификация.
2. Основные классы моделей.
3. Построение основных элементов финансовой модели проекта.
4. Моделирование изменения стоимости денег во времени.
5. Бизнес план: определение, структура, виды.
6. Информационные системы для инвестиционного проектирования и составления бизнес-планов.
7. Основные финансовые показатели бизнес-плана инвестиционного проекта.
8. Процесс построения инвестиционной модели.
9. Стратегия операционной деятельности предприятия по реализации проекта.
10. Формирование финансового плана реализации инвестиционных проектов.
11. Использование внутренних и внешних источников информации при формировании инвестиционного бизнес-плана.
12. Анализ чувствительности проекта.
13. Содержание форм и методов финансирования реальных инвестиций.
14. Использование анализа чувствительности при оценке эффективности инвестиционных проектов.
15. Сравнительная характеристика методов оценки эффективности инвестиционных проектов.

Задача

Рассматривается проект приобретения через четыре года складского приобретения за 1 млн. руб. Предприятие планирует в начале каждого года осуществлять взносы в банк в сумме 200 тыс. руб. Оцените, достаточно средств будет на счету в банке через указанный промежуток времени, если доходность инвестиций составляет 17%.

Задача

Сетевое торговое предприятие оценивает покупку новой информационной системы. Базовая цена системы – 250 тыс. руб. Ее модификация к конкретным условиям эксплуатации обойдется еще в 50 тыс. руб. Информационная система относится к имуществу с 3-летним сроком службы, предполагается ее продажу по истечении трех лет с 100 тыс. руб. Ее эксплуатация требует увеличения оборотного капитала на 10 тыс. руб. Информационная система не принесет дополнительных доходов, однако ожидается, что она будет экономить предприятию 100 тыс. руб. в год на операционных расходах до налогообложения (главным образом на трудозатратах). Налоговая ставка предприятия составляет 20%. Ставка дисконта – 20%.

Задача

Рассматривается проект реинжиниринг бизнес-процессов предприятия, позволит снизить затраты предприятия на 20 тыс. руб. в первый год, на 30 тыс. руб. во второй и на 45 тыс. руб. на третий год. В то же время проект предусматривает следующие расходы: первоначальные инвестиции – 20 тыс. руб.; расходы в первый год – 20тыс. руб.; во второй –15 тыс. руб.; в третий –15 тыс. руб. Ставка дисконтирования – 15%. Ставка налога на прибыль – 20%. Оцените эффективность проекта с использованием коэффициента выгоды-затраты.

Вопросы к контрольной работе (АПР)

1. Назовите требования, которым должен удовлетворять объект инвестиций.
2. Определите основные принципы принятия долгосрочных инвестиционных решений.
3. В каких условиях могут быть поставлены задачи принятия решений?
4. В каких условиях могут быть решены задачи принятия решений?
5. Какие параметры воздействуют на принятие инвестиционных решений?
6. Перечислите этапы принятия инвестиционных решений.
7. Назовите классические модели принятия инвестиционных решений.
8. Перечислите неклассические модели принятия инвестиционных решений.
9. Что такое "система принятия решений"?
10. Определите конечный результат принятия инвестиционных решений.
11. Определите характеристику модели оценки финансовых активов.
12. Охарактеризуйте модель арбитражного ценообразования.
13. Назовите роль факторных моделей для оценки инвестиционной привлекательности.
14. Определите условия проведения фундаментального анализа для оценки инвестиционной привлекательности.
15. Охарактеризуйте значение сравнительной оценки для определения инвестиционной привлекательности.
16. Назовите особенности использования модели Г. Марковица.
17. Определите условия использования рыночной модели для оценки инвестиционной привлекательности.
18. Охарактеризуйте возможности использования программного продукта "Альт-Инвест".
19. Назовите вопросы содержания и цели методики анализа инвестиционных проектов UNIDO.
20. В чем состоит Метод Монте-Карло?
21. Определите основные критерии использования экспертного анализа.
22. В чем состоит моделирование рисков инвестиционных проектов?
23. Опишите факторы риска при оценке эффективности проектов.
24. В чем заключается использование анализа сценариев для оценки эффективности проектов.
25. Опишите анализ безубыточности как метод оценки риска.
26. В чем состоит использование анализа чувствительности при оценке эффективности инвестиционных проектов?
27. Определите применение факторного анализа для оценки эффективности проектов.
28. Перечислите особенности метода Монте-Карло для оценки риска.
29. Опишите экспертный анализ как метод оценки риска.
30. Опишите план движения денежных средств.
31. Назовите основные статьи плана движения денежных средств.
32. Опишите план прибылей и убытков.
33. Назовите основные статьи плана прибылей и убытков.
34. Опишите балансовый план.
35. Назовите основные разделы и статьи баланса.
36. Определите взаимосвязи основных элементов финансовой модели проекта.
37. Назовите методы осуществления моделирования изменения стоимости денег во времени.
38. В чем заключается построение основных элементов финансовой модели проекта?
39. В чем заключается построение дополнительных элементов финансовой модели проекта?
40. В чем заключаются особенности бизнес-плана инвестиционного проекта?

41. Назовите разделы инвестиционного проекта.
42. Что такое цена разработки бизнес-плана?
43. От каких факторов зависит цена разработки бизнес-плана?
44. Определите основные ошибки при составлении бизнес-плана инвестиционного проекта.
45. Опишите ошибку “неверный выбор вида бизнес-плана”.
46. В чем заключаются ошибка “разработка бизнес-плана без технико-экономического обоснования (ТЭО)”?
47. Опишите ошибку “копирование БП инвестиционного проекта”.
48. В чем заключаются ошибка “покупка бизнес-планов без детального изучения”?
49. От каких факторов зависит эффективность разработки бизнес-плана?
50. Чистая приведенная стоимость – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
51. Внутренняя норма рентабельности – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
52. Коэффициент выгоды-затраты – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
53. Коэффициент рентабельности инвестиций – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
54. Период окупаемости инвестиций – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
55. Дисконтированный период окупаемости инвестиций – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
56. Учетная норма доходности – содержание критерия, методика расчета, преимущества и недостатки.
57. Перечислите подходы к выбору альтернативных проектов.
58. Назовите условия выбора проектов с разным жизненным циклом.
59. Определите нефинансовые критерии выбора проектов.
60. Определите цели, задачи, возможности системы Project Expert и направления работы с программным продуктом.

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по учебной дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по учебной дисциплине по очной форме обучения*

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль		
- дискуссия, собеседование (темы № 1-8)	1,5	12
- тестирование (темы № 1-8)	1	8
- разноуровневые задачи и задания (темы № 1-8)	1,5	12
- текущий модульный контроль (№ 1-2)	3	6
- текущий модульный контроль (№ 3)	2	2
Промежуточная аттестация	экзамен	40
Итого за семестр	100	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине по заочной форме обучения*

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль		
- дискуссия, собеседование (темы № 1-8)	1,5	12
- тестирование (темы № 1-8)	1	8
- разноуровневые задачи и задания (темы № 1-8)	1,5	12
- контрольная работа (№ 1,2)	3	6
- контрольная работа (№ 3)	2	2
Промежуточная аттестация	экзамен	40
Итого за семестр	100	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Экономическая сущность инвестиций.
2. Виды инвестиций.
3. Определение и цель инвестиционной деятельности.
4. Основные задачи инвестиционной деятельности.
5. Факторы, влияющие на инвестиционную деятельность.
6. Сущность инвестиционных решений.
7. Классификация инвестиционных решений.
8. Сфера применения термина «финансовое моделирование».
9. Определение финансовых моделей, цели их создания.
10. Классификация финансовых моделей.
11. Требования, которые выдвигаются к финансовым моделям.
12. Основные принципы финансового моделирования.
13. Задачи финансового моделирования.
14. Характеристика инструментов финансового моделирования.
15. Основные подходы к определению инвестиционной привлекательности.
16. Особенности модели Марковица.
17. Использование рыночной модели для оценки инвестиционной привлекательности.
18. Характеристика модели оценки финансовых активов.
19. Модель арбитражного ценообразования.
20. Роль факторных моделей для оценки инвестиционной привлекательности.
21. Проведение фундаментального анализа для оценки инвестиционной привлекательности.
22. Значение сравнительной оценки для определения инвестиционной привлекательности.
23. Возможности использования программного продукта «Альт-Инвест».
24. Содержание и цели методики анализа инвестиционных проектов UNIDO.
25. Цели, задачи и возможности системы Project Expert.
26. Направления работы с Project Expert.
27. Инвестиционная идея как основа для принятия управленческих решений.
28. Формирование инвестиционного замысла (идеи) проекта.
29. Подход к обоснованию инвестиционной идеи «сверху-вниз».
30. Направление обоснования инвестиционной идеи «снизу-вверх».
31. Причины появления инвестиционных идей.
32. Источники инвестиционных идей.
33. Требования к процессу отбора инвестиционных идей.
34. Причины отклонения инвестиционных идей.
35. Задачи оценки и выбора инвестиционных решений.
36. Система допущений при принятии инвестиционных решений.
37. Гипотеза экстремальности при принятии инвестиционных решений.
38. Требования критерия вариантности при выборе инвестиционной идеи.
39. Постулат системности при принятии инвестиционного решения.

40. Критерий риска и неопределенности при выборе инвестиционных проектов.
41. Каскад прогнозов в рамках подходы «сверху-вниз» в фундаментальном анализе.
42. Алгоритм реализации подхода «нисходящий анализ».
43. Характеристика и преимущества модифицированного нисходящего анализа.
44. Сущность и классификация финансовых моделей.
45. Принципы финансового моделирования.
46. Моделирование оценки инвестиционной привлекательности предприятия.
47. Инвестиционный анализ с использованием программных продуктов.
48. Экспертная система инвестиционного проектирования.
49. Показатели оценки эффективности инвестиционного проекта.
50. Основные принципы оценки эффективности инвестиционных проектов.
51. Сущность метода чистой настоящей (текущей, приведенной) стоимости и его роль в оценке эффективности инвестиций.
52. Сущность метода индекса рентабельности инвестиций (PI) и коэффициента эффективности инвестиций.
53. Сущность метода внутренней ставки рентабельности.
54. Сущность метода модифицированной внутренней ставки рентабельности.
55. Сущность простого метода определения срока окупаемости инвестиций.
56. Сущность дисконтированного метода определения срока окупаемости инвестиций.
57. Преимущества и недостатки экспертной системы инвестиционного проектирования.
58. Сущность простой линейной регрессии, роль в инвестиционном проектировании.
59. Показатели, применяемые для расчета простой линейной регрессии.
60. Положительные и отрицательные стороны применения простой линейной регрессии.
61. Возможности программы Excel для построения регрессионной модели.
62. Особенности финансового моделирования в Excel.
63. Возможности финансовых моделей в Excel.
64. Структура жизненного цикла инвестиционного проекта, его роль для инвестиционного проектирования.
65. Последовательность создания финансовых моделей проекта при вводе в них количественных и стоимостных данных.
66. Характеристика разделов анализа финансового моделирования.
67. Способы создания новых проектов в Project Expert.
68. Необходимая информация для инвестиционного проектирования в Project Expert.
69. Оценка инвестиционных рисков в Project Expert.
70. Преимущества финансового моделирования в Project Expert.
71. Моделирование рисков инвестиционных проектов.
72. Фактор риска при оценке эффективности проектов.
73. Использование анализа сценариев для оценки эффективности проектов.
74. Анализ безубыточности как метод оценки риска.
75. Использование анализа чувствительности при оценке эффективности инвестиционных проектов.
76. Применение факторного анализа для оценки эффективности проектов.
77. Особенности метода Монте-Карло для оценки риска.
78. Экспертный анализ как метод оценки риска.
79. Инвестиционные ресурсы – финансовая основа реализации инвестиционной стратегии предприятия.
80. Стратегия формирования инвестиционных ресурсов организации.
81. Финансовое обеспечение как основа формирования и реализации инвестиционных бизнес-планов.
82. Сущность, цели и задачи финансового моделирования инвестиций.
83. Значение финансовой модели как составной части экономического обоснования инвестиционного проекта.

84. Цели финансового моделирования.
85. Информационное обеспечение финансового моделирования.
86. Этапы построения финансовой модели при формировании инвестиционных проектов.
87. Методы построения финансовой модели инвестиционного проекта.
88. Требования к разработке инвестиционных проектов.
89. Основные разделы инвестиционного проекта.
90. Использование информационных технологий в инвестиционном проектировании.
91. Характеристика ППП Project Expert по разделам.
92. Информационная модель бизнес-плана инвестиционного проекта.
93. Использование внутренних и внешних источников информации при формировании инвестиционного бизнес-плана.
94. Сущность бизнес-планирования и его место в системе управления на предприятии.
95. Цели и задачи бизнес-планирования.
96. Виды бизнес-планов, их цели, задачи, принципы формирования.
97. Этапы составления бизнес-плана на современных предприятиях.
98. Положительные особенности использования собственного и заёмного капитала в инвестиционном проектировании.
99. Источники формирования инвестиционных ресурсов.
100. Система имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу								**Максимальная сумма баллов**
Смысловой модуль № 1		Смысловой модуль № 2				Смысловой модуль № 2		
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	
4	7	4	4	4	7	4	6	40

Примечание. Т1, Т2, ... Т8 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	**По государственной шкале**	**Определение**
90-100	«Отлично» (5)	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
80-89	«Хорошо» (4)	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10%)
75-79		в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 15%)
70-74	«Удовлетворительно» (3)	неплохо, но со значительным количеством недостатков
60-69		выполнение удовлетворяет минимальные критерии
35-59	«Неудовлетворительно» (2)	с возможностью повторной аттестации
0-34		с обязательным повторным изучением дисциплины (выставляется комиссией)

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Ефимова О.В., Музалев С.В. Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов [Электронный ресурс]: Учебник / О.В. Ефимова, С.В. Музалев. – Электрон. дан. – Москва: КноРус, 2025. –207 с. – Internet access. – ISBN 978-5-406-13646-1.

2. Лукасевич И.Я. Финансовое моделирование в фирме: учебник для вузов / И.Я. Лукасевич. – Москва: Издательство Юрайт, 2024. – 356 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-11944-2. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. –URL: https://urait.ru/bcode/542218. – Название с экрана.

3. Румянцева Е.Е. Инвестиционный анализ: учебное пособие для вузов / Е.Е. Румянцева. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 281 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-10389-2. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. –URL: https://urait.ru/bcode/513462. – Название с экрана.

Дополнительная литература:

1. Борисова О.В. Инвестиции в 2 т. Т. 1. Инвестиционный анализ: учебник и практикум для вузов / О.В. Борисова, Н.И. Малых, Л.В. Овешникова. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 218 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-01718-2. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/511196. – Название с экрана.

2. Инвестиционное проектирование: основы теории и практики / А.П. Москаленко, С.А. Москаленко, Р.В. Ревунов, Н.И. Вильдяева. – 2-е изд., стер. – Санкт-Петербург: Лань, 2023. – 376 с. – ISBN 978-5-507-46440-1. – Текст: электронный // Лань: электронно-библиотечная система. – URL: https://e.lanbook.com/book/310169. – Название с экрана.

3. Инновационная политика: учебник для вузов / Л.П. Гончаренко [и др.]; под редакцией Л.П. Гончаренко. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 229 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-11388-4. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/511022. – Название с экрана.

4. Коротков Э.М. Антикризисное управление : учебник для вузов / Э.М. Коротков. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 406 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-01066-4. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/510543. – Название с экрана.

5. Мальцева С.В. Инновационный менеджмент: учебник для вузов / С.В. Мальцева; ответственный редактор С.В. Мальцева. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 527 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-15607-2. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/510861. – Название с экрана.

6. Поляков Н.А. Управление инновационными проектами: учебник и практикум для вузов / Н.А. Поляков, О.В. Мотовилов, Н.В. Лукашов. – 2-е изд., испр. и доп. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 384 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-15534-1. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/511434. – Название с экрана.

7. Теоретическая инноватика: учебник и практикум для вузов / И.А. Брусакова [и др.]; под редакцией И.А. Брусаковой. – Москва: Издательство Юрайт, 2023. – 333 с. – (Высшее образование). – ISBN 978-5-534-04909-1. – Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. – URL: https://urait.ru/bcode/515135. – Название с экрана.

Учебно-методические издания:

1. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Электронный ресурс]: конспект лекций для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», оч. и заоч. форм обучения / Ю.В. Нефёдова; М-во образования и науки РФ, ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», Каф. финансов и

экон. безопасности. – Донецк: [ДОННУЭТ], 2025. – Локал. компьютер. сеть НБ ДОННУЭТ.

2. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Электронный ресурс]: метод. указания для проведения практ. и семин. занятий для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», оч. и заоч. форм обучения / Ю.В. Нефёдова; М-во образования и науки РФ, ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», Каф. финансов и экон. безопасности. – Донецк: [ДОННУЭТ], 2024. – Локал. компьютер. сеть НБ ДОННУЭТ.

3. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Электронный ресурс]: методические рекомендации для самостоятельной работы для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», оч. и заоч. форм обучения / Ю.В. Нефёдова; М-во образования и науки РФ, ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», Каф. финансов и экон. безопасности. – Донецк: [ДОННУЭТ], 2024. – Локал. компьютер. сеть НБ ДОННУЭТ.

4. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Электронный ресурс]: средства диагностики по курсу для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» очной и заочной форм обучения / Ю.В. Нефёдова; М-во образования и науки РФ, ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», Каф. финансов и экон. безопасности. – Донецк: [ДОННУЭТ], 2024. – Локал. компьютер. сеть НБ ДОННУЭТ.

5. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Текст]: индивид. задания для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», оч. и заоч. форм обучения / Ю.В. Нефёдова; М-во образования и науки РФ, ГО ВПО «Донец. нац. ун-т экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», Каф. финансов и экон. безопасности. – Донецк: [ДОННУЭТ], 2024. – Учеб.-метод. комплекс дисциплины.

6. Нефёдова Ю.В. Финансовое моделирование инвестиционных решений [Электронный ресурс]: дистанционный курс MOODLE для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» очной и заочной форм обучения / Ю.В. Нефёдова. – Донецк: ГО ВПО «ДОННУЭТ», 2025.

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC: версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – Текст: электронный.

2. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999– . – URL:http://catalog.donnuet.ru. – Текст : электронный.

3. Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». – Москва: ООО «Дата Экспресс», 2024– . – Текст : электронный.

4. IPR SMART : весь контент ЭБС Iprbooks : цифровой образовательный ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2007 –. – URL:http://www.iprbookshop.ru. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.

5. Лань : электронная-библиотечная система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://e.lanbook.com/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

6. СЭБ : Консорциум сетевых электронных бибилиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://seb.e.lanbook.com/ – Режим доступа: для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст: электронный.

7. Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва: Полпред Справочники, cop. 1997–2024. – URL:https://polpred.com. – Текст : электронный.

8. Bookonlime: дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017 –. – URL:https://bookonlime.ru. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.

9. Информио : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информио», 2009 –. – URL: https://www.informio.ru. – Текст : электронный.

10. Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006–. – URL:https://biblioclub.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический унтиниверситет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTreeInc., 2008– . – URL:http://liber.rea.ru/login.php. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Финансовый университет, 2019– . – URL:http://library.fa.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

13. Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 – . – URL:https://library.lib.sfedu.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.

14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, cop. 2000–2024. – URL:https://elibrary.ru. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст : электронный.

15. CYBERLENINKA : Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012 – . – URL:http://cyberleninka.ru. – Текст : электронный.

16. Национальная электронная библиотека : НЭБ : федеральная государственная информационная система / Министерство культуры Российской Федерации [и др.]. – Москва: Российская государственная библиотека : ООО ЭЛАР, [2008 –]. – URL:https://rusneb.ru/ – Текст. Изображение: электронные.

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП ВО магистратуры перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры финансов и экономической безопасности (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчества	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании
Нефёдова Юлия Витальевна	По основному месту работы	Должность – доцент, ученая степень-кандидат экономических наук, ученое звание - доцент	Высшее, финансы, финансист, диплом кандидата наук ДК № 000187	1.Удостоверение о повышении квалификации №110400009603 «Информационные технологии в образовании. Преподаватель дистанционного обучения», 28.02.2022 г. Филиал Ухтинского государственного технического университета, г. Усинск. 2. Документ о повышении квалификации рег. номер 1-14902. «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое, психолого-педагогическое и методическое сопровождение», 26-28.09.2022 г. ФГБОУ ВО «Донской государственный технический университет», г. Ростов-на-Дону. 3. Документ о квалификации рег. номер 1-21871 «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлениям подготовки: Экономика и управление», 24-27.10.2023 г., ФГБОУ ВО «Донской государственный технический университет», г. Ростов-на-Дону. 4.Удостоверение о повышении квалификации №110400002601. «Специалист по работе с системами искусственного интеллекта по направлениям», 28.06.2025 г. ГАМП им. Н.П. Пастухова ТГУ, г. Ярославль.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.04 ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ИНВЕСТИЦИОНЫХ РЕШЕНИЙ

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
Магистерская программа Финансы и кредит
Трудоемкость учебной дисциплины: 3 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: основы финансового моделирования инвестиционных решений; содержание процесса стратегического управления инвестициями и ресурсами предприятия в процессе инвестирования; основные схемы финансирования инвестиционных проектов; методы оценки экономической эффективности инвестиционных проектов; современное программно-информационное обеспечение, необходимое для прогнозирования и решения экономических задач и регулирования денежных и финансовых потоков.

уметь: использовать современное программно-информационное обеспечение для решения финансово-экономических задач; сформировать инвестиционный бизнес-план действующего предприятия, исходя из его первичных данных и целевых установок инвестиционной стратегии; использовать полученные результаты в сформированный инвестиционный проект; оценить полученные результаты посредством использования методов оценки эффективности инвестиционных проектов.

владеть: практическими навыками деятельности в профессиональной сфере; информационной базой финансового моделирования инвестиционных решений; разработкой стратегических целей развития предприятия; финансовым обеспечением процесса инвестирования; основами проведения анализа риска и достоверности инвестиционных проектов.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-3 Способен разрабатывать финансовый план для клиента и целевой инвестиционный портфель	ИД-1ПК-3 Осуществляет моделирование целевого портфеля. ИД-2ПК-3 Составляет прогноз денежного потока.

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Теоретические аспекты финансового моделирования инвестиционных решений.

Тема 1. Основы принятия инвестиционных решений.

Тема 2 Финансовое моделирование в инвестиционных проектах.

Смысловой модуль 2. Формирование направлений стратегического развития организации.

Тема 3. Разработка инвестиционных идей.

Тема 4. Анализ инвестиционных решений.

Тема 5. Моделирование рисков инвестиционных проектов.

Смысловой модуль 3. Разработка финансовой модели инвестиционного проекта.

Тема 6. Финансовое моделирование и оценка проектов.

Тема 7. Информационная модель бизнес-плана инвестиционного проекта.

Тема 8. Система имитационного моделирования финансовых показателей бизнес-плана инвестиционного проекта.

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Разработчик:
Нефёдова Ю.В.,
кандидат экономических наук, доцент

Заведующая кафедрой финансов
и экономической безопасности
Омельянович Л.А.,
доктор экономических наук, профессор