

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования «Российский университет дружбы народов»**

Экономический факультет

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Финансовое моделирование в Excel

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МСН для направления подготовки/специальности:

38.03.01 «Экономика»

(код и наименование направления подготовки/специальности)

Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):

«Финансы и кредит»

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2022 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Финансовое моделирование в Excel» является получение комплекса знаний и умений в построении финансовой модели инвестиционного проекта для анализа его финансовой реализуемости и эффективности его осуществления, а также об оптимизации финансовых потоков по проекту, составляющему часть инвестиционной деятельности организации, с раскрытием критериев и показателей, применяемых в ходе такого анализа.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Финансовое моделирование в Excel» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
УК-2;	Способность определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.1 - В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы УК-2.2 - Анализирует план-график реализации проекта в целом и выбирает оптимальный способ решения поставленных задач, исходя из действующих правовых норм и имеющихся ресурсов и ограничений УК-2.3 - Контролирует ход выполнения проекта, корректирует план-график в соответствии с результатами контроля
ОПК-2;	Способность осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач;	ОПК-2.1 - Владеет методами и средствами сбора, обработки и анализа информации, необходимой для решения стандартных задач технико-экономической оценки мероприятий в области профессиональной деятельности ОПК-2.2 - Понимает основы информационной и библиографической культуры, позволяющих выбрать актуальную информацию, требуемую для проведения технико-экономических расчетов в профессиональной деятельности
ПКО-1	Способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собирать необходимые данные, анализировать их и готовить информационные обзоры и аналитические отчеты для решения задач профессиональной деятельности	ПКО-1.1 - Способен производить оценку достоверности исходных данных из достоверных источников ПКО-1.2 - Способен осуществлять сравнительный анализ источников финансирования, анализ результатов применения конкретных финансовых инструментов ПКО-1.3 - Способен осуществлять планирование финансовых показателей, индикаторов и конкретных мероприятий по результатам проведенного анализа

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Финансовое моделирование в Excel» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1 ОП ВО.

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Финансовое моделирование в Excel».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-2;	Способность определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Методы оптимальных решений Бухгалтерский учет Финансы Деньги, кредит, банки Основы научных исследований Финансовый менеджмент Бюджетная система РФ Страхование Финансы общественного сектора Экономика предприятия Рынок ценных бумаг Банковское дело Налоги и налогообложение Инвестиции Управление рисками Правоведение Финансовые рынки Управление капиталом организации	-
ОПК-2;	Способность осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач;	Методы оптимальных решений Статистика Бухгалтерский учет Анализ хозяйственной деятельности Экономическая география Финансовая математика Страхование	-

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		Налоги и налогообложение	
ПКО-1	Способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собирать необходимые данные, анализировать их и готовить информационные обзоры и аналитические отчёты для решения задач профессиональной деятельности	Экономическая география Основы научных исследований Финансовая математика Экономическая информатика Информационные системы в экономике Экономика предприятия Налоги и налогообложение Правоведение Основы цифровой экономики Системы управления базами данных Пространственный анализ экономики Финансовые рынки Управление капиталом организации	-

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Финансовое моделирование в Excel» составляет 3 зачетных единиц.

Таблица 4.2. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для **ОЧНО-ЗАОЧНОЙ** формы обучения*

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		7	8	9	A
Контактная работа, ак.ч.	20				20
в том числе:					
Лекции (ЛК)					
Лабораторные работы (ЛР)					
Практические/семинарские занятия (СЗ)	28				28
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	80				80
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.					
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108			108
	зач.ед.	3			3

* - заполняется в случае реализации программы в очно-заочной форме

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Понятие финансовой модели	<ol style="list-style-type: none"> 1. Предпосылки построения модели. 2. Сфера применения финансового моделирования. 3. Цели и задачи построения финансовой модели. 4. Типы финансовых моделей. 5. Основные источники информации для построения финансовой модели. 	
Основные термины и понятия в финансовом моделировании, расчетные показатели, отчетность, функции Excel, стандарты моделирования	<ol style="list-style-type: none"> 1. Финансовые потоки и их соответствие видам деятельности инвестиционного проекта 2. Показатели финансовой реализуемости проекта. Финансовая отчетность, используемая в финансовом моделировании. 3. Использование аналитических функций Excel в финансовом моделировании. 4. Основные показатели эффективности инвестиционных проектов. 5. Стандарты финансового моделирования. 	
Построение финансовой модели	<ol style="list-style-type: none"> 1. Структура и логика построения финансовой модели в MS Excel. 2. Основные правила моделирования в MS Excel. 3. Определение оптимальной структуры финансирования. 4. Методология анализа и прогнозирования финансовой модели. 	
Оценка эффективности инвестиционного проекта	<ol style="list-style-type: none"> 1. Расчет показателей эффективности и аналитических коэффициентов. 2. Интерпретация результатов, проверка расчетов и добавление флагов для поиска и устранения ошибок. 3. Методы количественного и сценарного анализа при оценке рисков. 	

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – семинарские занятия.

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)																														
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве 21 шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	<p>ауд. 430 Моноблок Lenovo AIO-300-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21"</p> <p>MS Windows 10 64bit 86626883 Microsoft Office 2016 86626883 Expert Systems 18487N SAP договор № С-16/15 Корпорация Галактика free Система БЭСТ-ОФИС 40475 Eviews10 70U00460 7-Zip free FastStone Image Viewer free FreeCommander free Adobe Reader free K-Lite Codec Pack free АЛЬТ-Инвест Сумм 8 95326045 АЛЬТ-Финансы 3 80603974 MS Power BI Desktop free</p> <table border="1" data-bbox="997 1120 1471 2020"> <thead> <tr> <th data-bbox="997 1120 1241 1187">Наименование</th> <th data-bbox="1241 1120 1471 1187">Реквизиты лицензии</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="997 1187 1241 1254">MS Windows 10 64bit</td> <td data-bbox="1241 1187 1471 1254">86626883</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1254 1241 1321">Microsoft Office 2016</td> <td data-bbox="1241 1254 1471 1321">86626883</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1321 1241 1366">Expert Systems</td> <td data-bbox="1241 1321 1471 1366">18487N</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1366 1241 1433">SAP</td> <td data-bbox="1241 1366 1471 1433">договор № С-16/15</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1433 1241 1500">Корпорация Галактика</td> <td data-bbox="1241 1433 1471 1500">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1500 1241 1568">Система БЭСТ-ОФИС</td> <td data-bbox="1241 1500 1471 1568">40475</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1568 1241 1612">Eviews10</td> <td data-bbox="1241 1568 1471 1612">70U00460</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1612 1241 1657">7-Zip</td> <td data-bbox="1241 1612 1471 1657">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1657 1241 1724">FastStone Image Viewer</td> <td data-bbox="1241 1657 1471 1724">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1724 1241 1769">FreeCommander</td> <td data-bbox="1241 1724 1471 1769">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1769 1241 1814">Adobe Reader</td> <td data-bbox="1241 1769 1471 1814">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1814 1241 1881">K-Lite Codec Pack</td> <td data-bbox="1241 1814 1471 1881">free</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1881 1241 1971">АЛЬТ-Инвест Сумм 8</td> <td data-bbox="1241 1881 1471 1971">95326045</td> </tr> <tr> <td data-bbox="997 1971 1241 2020">АЛЬТ-Финансы 3</td> <td data-bbox="1241 1971 1471 2020">80603974</td> </tr> </tbody> </table>	Наименование	Реквизиты лицензии	MS Windows 10 64bit	86626883	Microsoft Office 2016	86626883	Expert Systems	18487N	SAP	договор № С-16/15	Корпорация Галактика	free	Система БЭСТ-ОФИС	40475	Eviews10	70U00460	7-Zip	free	FastStone Image Viewer	free	FreeCommander	free	Adobe Reader	free	K-Lite Codec Pack	free	АЛЬТ-Инвест Сумм 8	95326045	АЛЬТ-Финансы 3	80603974
Наименование	Реквизиты лицензии																															
MS Windows 10 64bit	86626883																															
Microsoft Office 2016	86626883																															
Expert Systems	18487N																															
SAP	договор № С-16/15																															
Корпорация Галактика	free																															
Система БЭСТ-ОФИС	40475																															
Eviews10	70U00460																															
7-Zip	free																															
FastStone Image Viewer	free																															
FreeCommander	free																															
Adobe Reader	free																															
K-Lite Codec Pack	free																															
АЛЬТ-Инвест Сумм 8	95326045																															
АЛЬТ-Финансы 3	80603974																															

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)	
		MS Power BI Desktop	free

* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Жаров, Д. Финансовое моделирование в Excel / Д. Жаров; ред. С. Кривошеина. - Москва: Альпина Паблишер, 2016. - 169 с.: табл., схем. - ISBN 978-5-9614-0885-0; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=443014> (17.09.2018).
2. Шнюкова, Е.А. Финансовый анализ и финансовое моделирование: учебное пособие / Е.А. Шнюкова; Министерство образования и науки Российской Федерации, Сибирский Федеральный университет. - Красноярск: СФУ, 2017. - 92 с.: ил. - Библиогр.: с. 86. - ISBN 978-5-7638-3699-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=497527> (01.02.2019).
3. Смирнов Владимир Борисович, Кирюхина Светлана Евгеньевна. Проектный анализ. Практическая часть: В 2-х частях: Учебно-методическое пособие. Ч. 1 / В.Б. Смирнов, С.Е. Кирюхина. - М.: Изд-во РУДН, 2018. - 78 с. - ISBN 978-5-209-08845-5. - ISBN 978-5-209-08844-8: 66.64.

Дополнительная литература:

1. Балихина, Н.В. Финансы и кредит : учебное пособие / Н.В. Балихина, М.Е. Косов. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : Юнити-Дана, 2015. - 303 с. - ISBN 978-5-238-02355-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118960> (17.09.2018).
2. Нешитой, А.С. Финансы и кредит : учебник / А.С. Нешитой. - 6-е изд., перераб. и доп. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. - 576 с. : ил. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02006-3 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=495804> (05.12.2018).

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:
 - Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
 - ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
 - ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
 - ЭБС «Консультант студента» www.studentlibrary.ru

- ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
- ЭБС «Троицкий мост»

2. Базы данных и поисковые системы:

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации <http://docs.cntd.ru/>
- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
- поисковая система Google <https://www.google.ru/>
- реферативная база данных SCOPUS <http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля:*

1. Курс лекций по дисциплине «Финансовое моделирование в Excel».

* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Финансовое моделирование в Excel» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.

**И.о. зав. кафедрой «Финансы
и кредит»**

Наименование БУП



Подпись

Е.М. Григорьева

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

**профессор кафедры
«Финансы и кредит»**



А.Я. Быстряков

