

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Моисеев Роман Евгеньевич

Должность: Проректор по образовательной деятельности

Дата подписания: 26.01.2024 14:19:43

Уникальный идентификатор документа:

8332314f4b9fba6296d10b638ac7765c3747d0ffe

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего
образования «Казанский национальный исследовательский технический**

университет им. А.Н. Туполева-КАИ»

(КНИТУ-КАИ)

Чистопольский филиал «Восток»

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ К САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЕ

по дисциплине

ФИНАНСОВОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ

Индекс по учебному плану: **Б1.В.05.02**

Направление подготовки: **09.03.03 Прикладная информатика**

Квалификация: **Бакалавр**

Профиль подготовки: **прикладная информатика в цифровой экономике**

Типы задач профессиональной деятельности: **производственно-технологический, проектный**

Рекомендовано УМК ЧФ КНИТУ-КАИ

Чистополь

2023 г.

Целью самостоятельной работы обучающихся является обучение навыкам работы с научно-теоретической литературой и практическими материалами, необходимыми для углубленного изучения дисциплины, а также развитие у них устойчивых способностей к самостоятельному изучению и изложению полученной информации.

Учебным планом предусмотрена самостоятельная работа студентов:

Таблица 1 – Объем дисциплины по разделам

№ п/п	Наименование изучаемого раздела	Всего	Объем дисциплины для самостоятельной работе
1	Основные понятия финансового моделирования. Применение оптимизационных моделей при решении задач финансового управления	32	20
2	Методы и модели анализа динамики финансовых показателей и построения финансовых прогнозов	38	20
3	Экспертные методы анализа в финансовой деятельности организации	37,65	19,65

1 Основные понятия финансового моделирования. Применение оптимизационных моделей при решении задач финансового управления

Место моделирования при решении практических задач финансового управления. Примеры решения прикладных задач финансового управления с использованием оптимизационных моделей. Использование инструментов финансового моделирования в среде Ms Excel для нахождения варианта оптимального решения.

2 Методы и модели анализа динамики финансовых показателей и построения финансовых прогнозов

Прогнозирование динамики финансовых показателей на основе трендовых моделей. Построение финансовых прогнозов с использованием модели Брауна (метода экспоненциального сглаживания) в среде Ms Excel.

3 Экспертные методы анализа в финансовой деятельности организации

Экспертные методы оценки и их применение в финансовом управлении. Характеристика экспертных процедур. Общая схема экспертизы. Виды используемых экспертных оценок. Анализ, статистическая обработка экспертных

оценок, проверка согласованности мнений экспертов при помощи значения коэффициента конкордации.

В рамках самостоятельной работы по каждой теме необходимо изучить основную указанную литературу, а также прочитать рекомендуемые в рабочей программе дополнительную литературу и интернет-ресурсы. Студент должен подготовиться к защите выполненных лабораторных работ.

Основная литература

1. Математическое моделирование инвестиционных и финансовых решений: учебное пособие / А. Ю. Кузьмин. - Москва: Прометей, 2020. - 176 с. - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1851296>
2. Финансовое моделирование в Excel / Д. Жаров. — Москва: Альпина Паблишер, 2016. — 170 с. — URL: <https://e.lanbook.com/book/95178>

Дополнительная литература

1. Вероятностное моделирование в финансово-экономической области: учебное пособие / Л.Г. Лабскер. — Москва: ИНФРА-М, 2024. — 172 с. — URL: <https://znanium.com/catalog/product/2053244>
2. Финансовое моделирование в фирме: учебник для вузов / И. Я. Лукасевич. — Москва: Издательство Юрайт, 2022. — 356 с. — URL: <https://urait.ru/bcode/517878>

Методические материалы

1. Методические указания по практическим занятиям по дисциплине «Финансовое моделирование» в электронном виде (место хранения – библиотека ЧФ КНИТУ-КАИ).

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных си-

стем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

1. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы. URL: <https://e.lanbook.com/>.

2. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы. URL: <http://znanium.com/>.

3. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы. URL: <https://urait.ru/>.

4. Научно-техническая библиотека КНИТУ-КАИ. URL: <https://kai.ru/web/naucno-tehniceskaa-biblioteka>.

5. Единое окно доступа к информационным ресурсам. URL: <http://window.edu.ru>.