

## СИЛАБУС

### навчальної дисципліни «Фінансове моделювання»

|   |   |
|---|---|
| Спеціальність   | 072 "ФІНАНСИ, БАНКІВСЬКА СПРАВА ТА СТРАХУВАННЯ"   |
| Освітня програма  | ФІНАНСИ, БАНКІВСЬКА СПРАВА ТА СТРАХУВАННЯ   |
| Рівень вищої освіти   | Перший (бакалаврський) / Другий (магістерський)   |
| Статус навчальної дисципліни                                      | обов'язкова / вибіркова   |
| Курс / семестр вивчення   | 2 курс, 3 семестр   |
| Кількість кредитів ЄКТС   | 5   |
| Розподіл за видами занять та годинами навчання                    | Лекції - <u>32</u> год.   |
|   | Практичні / семінарські / лабораторні заняття – <u>32</u> год.  |
|   | Самостійна робота - <u>86</u> год.  |
| Вид індивідуального завдання                                      | реферат / контрольна робота /самостійна робота  |
| Форма підсумкового контролю                                       | екзамен ( електронне тестування)  |
| Дні занять  | Понеділок, середа   |
| Консультації  | Очні консультації: згідно з графіком<br>Дистанційні: Classroom, електронна пошта, групи у Вайбері, Телеграмі  |
| Кафедра (назва, № кабінету, корпоративна e-mail)                  | Кафедра маркетингу, фінансів, банківської справи та страхування. Каб.115  |
| <b>Анотація навчальної дисципліни:</b>                            |   |
| Мета навчальної дисципліни:                                       | Отримання студентами фундаментальних теоретичних і практичних знань, щодо економічного явища та обґрунтування управлінського рішення суб'єкту ринку чи на основі методів математичного, економетричного і статистичного моделювання.  |
| Мета орієнтована на формування у студентів таких компетентностей: | ЗК01. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.<br>ЗК02. Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.<br>ЗК05. Навички використання інформаційних та комунікаційних технологій.<br>ЗК06. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні.<br>ЗК07. Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.<br>ЗК08. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел.<br>ЗК09. Здатність бути критичним і самокритичним. |

|                                       |   |
|---------------------------------------|---|
|                                       | <p>ЗК10. Здатність працювати у команді. ЗК12 Здатність працювати</p> <p>СК01. Здатність досліджувати тенденції розвитку економіки за допомогою інструментарію макро- та мікроекономічного аналізу, оцінювати сучасні економічні явища.</p> <p>СК02. Розуміння особливостей функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.</p> <p>СК03. Здатність до діагностики стану фінансових систем (державні фінанси, у тому числі бюджетна та податкова системи, фінанси суб'єктів господарювання, фінанси домогосподарств, фінансові ринки, банківська система та страхування).</p> <p>СК04. Здатність застосовувати економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач.</p> <p>СК06. Здатність застосовувати сучасне інформаційне та програмне забезпечення для отримання та обробки даних у сфері фінансів, банківської справи та страхування.</p> <p>СК07. Здатність складати та аналізувати фінансову звітність.</p> <p>СК08. Здатність виконувати контрольні функції у сфері фінансів, банківської справи та страхування.</p> <p>СК09. Здатність здійснювати ефективні комунікації.</p> <p>СК11. Здатність підтримувати належний рівень знань та постійно підвищувати свою професійну підготовку автономно.</p> |
| <p>Очікувані результати навчання:</p> | <p>ПР03. Визначати особливості функціонування сучасних світових та національних фінансових систем та їх структури.</p> <p>ПР06. Застосовувати відповідні економіко-математичні методи та моделі для вирішення фінансових задач.</p> <p>ПР07. Розуміти принципи, методи та інструменти державного та ринкового регулювання діяльності в сфері фінансів, банківської справи та страхування.</p> <p>ПР08. Застосовувати спеціалізовані інформаційні системи, сучасні фінансові технології та програмні продукти.</p> <p>ПР09. Формувати і аналізувати фінансову звітність та правильно інтерпретувати отриману інформацію.</p> <p>ПР10. Ідентифікувати джерела та розуміти методологію визначення і методи отримання економічних даних, збирати та аналізувати необхідну фінансову інформацію, розраховувати показники, що характеризують стан фінансових систем.</p> <p>ПР12. Використовувати професійну аргументацію для донесення інформації, ідей, проблем та способів їх вирішення до фахівців і нефахівців у фінансовій сфері діяльності.</p> <p>ПР14. Вміти абстрактно мислити, застосовувати аналіз та синтез для виявлення ключових характеристик</p>   |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>фінансових систем, а також особливостей поведінки їх суб'єктів.</p> <p>ПР16. Застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати.</p> <p>ПР18. Демонструвати базові навички креативного та критичного мислення у дослідженнях та професійному спілкуванні.</p> <p>ПР19. Виявляти навички самостійної роботи, гнучкого мислення, відкритості до нових знань.</p> <p>ПР20. Виконувати функціональні обов'язки в групі, пропонувати обґрунтовані фінансові рішення.</p> <p>ПР21. Розуміти вимоги до діяльності за спеціальністю, зумовлені необхідністю забезпечення сталого розвитку України, її зміцнення як демократичної, соціальної, правової держави.</p> |
| <p style="text-align: center;"><b>Перелік тем:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Методологічні основи і принципи фінансового моделювання.</li> <li>2. Підготовка фінансової моделі в середовищі MS Excel для інвестиційного проектування.</li> <li>3. Розрахунки за допомогою електронних таблиць в середовищі Microsoft Excel.</li> <li>4. Регресійний аналіз фінансових даних і тренди.</li> <li>5. Основи інвестування і операції з фінансовими інвестиціями.</li> <li>6. Оптимізаційні задачі програмування в економіці та фінансах.</li> <li>7. Математичні основи комп'ютерного моделювання.</li> <li>8. Наближені методи для розв'язання диференціальних рівнянь.</li> <li>9. Імітаційні методи для моделювання імовірних сценаріїв і оцінки інвестиційних ризиків.</li> <li>10. Фінансове моделювання на персональному комп'ютері.</li> <li>11. Оптимізація податкової системи і моделювання боргового навантаження.</li> <li>12. Моделювання економічних явищ, співвідношень і пропорцій розвитку економіки.</li> <li>13. Моделювання монетарної політики в банківській системі.</li> <li>14. Основи оптимізаційних завдань на основі елементів задачі «витрати-випуск».</li> </ol>   |   |
| <p style="text-align: center;"><b>Рекомендовані джерела:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Буряк П.Ю., Рімар М. В., Бець М. Т. Фінансово-економічний аналіз: підручник / за заг. ред. П. Ю. Буряка, М. В. Рімара. К.: ВД «Професіонал», 2014. 528 с.</li> <li>2. Економічний аналіз і моделювання господарської діяльності підприємства: навчальний посібник / М.В. Румянцев, Н.В. Касьянова, Д.В. Солоха, О.О. Тарасова. Донецьк: ДонНТУ, 2013. 296 с.</li> <li>3. Куліков П. М., Іващенко Г. А. Економіко-математичне моделювання фінансового стану підприємства. Навчальний посібник. Харків: Вид. ХНЕУ, 2009. 133 с.</li> <li>4. Лещинський, О. Л. Економетрія : навч. посібник для студ. вищ. навч. закладів [Текст] / О. Л. Лещинський, В. В. Рязанцева, О. О. Юнькова. – К. : МАУП. – 2003. – 205 с.</li> <li>5. Наконечний, С. І. Економетрія: Підручник [Текст] / С. І. Наконечний, Т. О. Терещенко, Т. П. Романюк. – К. : КНЕУ, 1997. – 352с.</li> <li>6. Островський П.І., Гострик О.М., Добрунік Т.П., Радова О.В. Моделювання економічних процесів: навчальний посібник. Одеса, ОНЕУ, 2012. 132 с.</li> <li>7. Отенко І. П., Азаренков Г. Ф., Іващенко Г. А. Фінансовий аналіз: навчальний посібник. Х.: ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2015. 156 с.</li> </ol> |   |

8. Наконечний, С. І. Економетрія: Підручник [Текст] / С. І. Наконечний, Т. О. Терещенко, Т. П. Романюк. – К. : КНЕУ, 1997. – 352с

**Система оцінювання результатів навчання:**

**Схема розподілу балів:**

|                |                                 |   |                                    |
|----------------|---------------------------------|---|------------------------------------|
| <b>Екзамен</b> | 50 балів<br>(поточний контроль) | 10 балів (контроль виконання індивідуальних завдань)    | 40 балів<br>(підсумковий контроль) |
| <b>Залік</b>   | 70 балів<br>(поточний контроль) | 30 балів<br>(контроль виконання індивідуальних завдань) |                                    |

**Мінімальний пороговий рівень з кожного виду контролю:**

|                |                                 |   |                                    |
|----------------|---------------------------------|---|------------------------------------|
| <b>Екзамен</b> | 30 балів<br>(поточний контроль) | 6 балів (контроль виконання індивідуальних завдань)     | 25 балів<br>(підсумковий контроль) |
| <b>Залік</b>   | 45 балів<br>(поточний контроль) | 15 балів<br>(контроль виконання індивідуальних завдань) |                                    |

**Накопичування рейтингових балів з навчальної дисципліни:**

**Накопичування рейтингових балів з навчальної дисципліни (поточний контроль) відбувається під час оцінювання контролю знань таких видів навчальних робіт:**

- 1) Доповіді, виступи на семінарських заняттях;
- 2) Звіти з виконання практичних робіт;
- 3) Усне опитування;
- 4) Письмові роботи з засвоєння тем курсу;
- 5) Виконання завдань самостійної роботи
- 6) .....

**Шкала оцінювання результатів навчання:**

| Сума балів за всі види навчальної діяльності | Шкала ЕКТС | Оцінка за національною шкалою                              |   |
|--|------------|--|---|
|  |            | для екзамену, курсового проекту (роботи)                   | для заліку  |
| 90-100                                       | A          | відмінно   | зараховано  |
| 82-89  | B          | добре  |   |
| 74-81  | C          |  |   |
| 64-73  | D          | задовільно   |   |
| 60-63  | E          |  |   |
| 35-59  | FX         | незадовільно з можливістю повторного складання             | не зараховано з можливістю повторного складання             |
| 1-34   | F          | незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни | не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни |

**Політика курсу:**

**Політика дотримання академічної доброчесності**

Викладання навчальної дисципліни ґрунтується на засадах академічної доброчесності. Порушеннями академічної доброчесності вважаються: академічний плагіат, фабрикація, фальсифікація, списування.

За порушення академічної доброчесності студенти можуть бути притягнені до такої академічної відповідальності: повторне проходження оцінювання (контрольна робота, іспит тощо); повторне проходження відповідного освітнього компонента освітньої програми.

#### ***Комунікаційна політика***

Студенти повинні мати активовану пошту.

Обов'язком студента є перевірка один раз на тиждень (щонеділі) поштової скриньки та відвідування, перегляд інформації в Viber, Телеграм-каналах групи.

Протягом тижнів самостійної роботи обов'язком студента є робота з дистанційним курсом «Фінансове моделювання».

Усі письмові запитання до викладачів стосовно курсу мають надсилатися на університетську електронну пошту кафедри.

#### ***Політика щодо пропусків занять***

Студенти мають відвідувати лекційні й практичні (семінарські) заняття. Відсутність студента на занятті може бути виправдана поважною причиною. Поважними причинами відсутності вважаються: хвороба, участь у Всеукраїнській студентській олімпіаді, Всеукраїнському конкурсі студентських наукових робіт чи будь-якому іншому заході, який можна віднести до заходів, що сприяють розвитку студентів і поліпшенню іміджу університету (факультету).

#### ***Політика щодо виконання навчальних завдань пізніше встановленого терміну***

Студенти мають виконувати всі навчальні завдання у встановлені терміни. Студент, який не виконав ту чи іншу кількість навчальних завдань вчасно й хоче надолужити прогапане, може звернутися по допомогу до викладача.

#### ***Політика щодо оскарження оцінювання***

Якщо студент не згоден з оцінюванням його знань він може оскаржити виставлену викладачем оцінку у встановленому порядку.

#### ***Бонуси***

Студенти, які регулярно відвідували лекції (мають не більше двох пропусків без поважних причин) та мають написаний конспект лекцій отримують додатково 2 бали до результатів оцінювання до підсумкової оцінки.