

## АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

### Наименование дисциплины (модуля)

Методы финансового анализа

### Наименование ОПОП ВО

38.03.05 Бизнес-информатика. Бизнес-аналитика

### Цели и задачи дисциплины (модуля)

Цель изучения дисциплины - научить принятию управленческих решений в финансовой сфере с учетом фактора времени, многокритериальности и стохастичности реальных процессов.

Задачами изучения дисциплины являются:

- знакомство с современными математическими моделями финансовых рынков, функционирующих в условиях неопределенности;

- дать основы количественных методов и приёмов, применяемых в анализе управления рисками;

- научить использованию компьютерных технологий при принятии управленческих решений (моделирование и исчисление важнейших финансовых показателей – характеристик денежных потоков, критериев эффективности инвестиционных проектов).

### Результаты освоения дисциплины (модуля)

Планируемыми результатами обучения по дисциплине являются знания, умения, навыки, соотнесенные с компетенциями, которые формирует дисциплина, и обеспечивающие достижение планируемых результатов по образовательной программе в целом. Перечень компетенций, формируемых в результате изучения дисциплины, приведен в таблице 1.

Таблица 1 – Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

Название ОПОП ВО, сокращенное	Код и формулировка компетенции	Код и формулировка индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине		
			Код результата	Формулировка результата	
38.03.05 «Бизнес-информатика» (Б-БИ)	ОПК-6 : Способен выполнять отдельные задачи в рамках коллективной научно-исследовательской, проектной и учебно-профессиональной деятельности для поиска, выработки и применения новых решений в области информационно-коммуникационных технологий	ОПК-6.2к : Выполняет технико-экономическое обоснование проектов по совершенствованию и регламентации бизнес-процессов и ИТ-инфраструктуры предприятия	РД1	Знание	методов построения моделей финансовых потоков для хозяйствующих субъектов, явлений и процессов
			РД2	Умение	моделирование финансовых потоков с учётом рисков при разработке и реализации проектов по оптимизации архитектуры, бизнес-процессов хозяйствующих субъектов

ПКВ-1 : Способен применять математические методы и ИКТ для анализа экономических процессов и разработки стратегий социально-экономических систем	ПКВ-1.1к : Применяет математические методы анализа глобальной экономики, макро- и микроэкономических процессов и систем	РД3	Знание	методы построения моделей финансовых потоков социально-экономических систем на микро-, мезоуровне
		РД4	Умение	рассчитывать финансовые показатели, количественно анализировать неопределённости и риски финансовых потоков; хеджировать риски проектов и мероприятий при реализации стратегий социально-экономических систем
ПКВ-2 : Способен осуществлять планирование и организацию проектной деятельности любого масштаба в условиях высокой неопределенности, вызываемой запросами на изменения и рисками, и с учетом влияния организационного окружения проектов	ПКВ-2.2к : Осуществляет разработку бизнес-планов для организации предпринимательской деятельности на основе анализа рынков	РД5	Умение	рассчитывать финансовые показатели, количественно анализировать неопределённости и риски финансовых потоков; хеджировать риски проектов и мероприятий
		РД6	Умение	анализировать влияние структуры финансирования на результаты деятельности и рассчитывать критерии эффективности инвестиционных проектов с учётом рисков

### Основные тематические разделы дисциплины (модуля)

- 1) Основные понятия, структуры, инструменты, цели и задачи финансового анализа и финансовой инженерии
- 2) Характеристики финансовых операций в условиях определенности
- 3) Характеристики финансовых операций в условиях неопределенности и теория арбитража.
- 4) Оптимальный портфель ценных бумаг
- 5) Инвестиции в производные финансовые инструменты
- 6) Анализ инвестиционных проектов
- 7) Оценка рискованных инвестиций, ориентированных на рынок

### Трудоемкость дисциплины (модуля) и виды учебной работы

Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу с обучающимися (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу по всем формам обучения, приведен в таблице 2.

Таблица 2 – Трудоёмкость дисциплины

Название ОПОП ВО	Форма обуче- ния	Часть УП	Семестр (ОФО) или курс (ЗФО, ОЗФО)	Трудо- емкость	Объем контактной работы (час)					СРС	Форма аттес- тации	
				(З.Е.)	Всего	Аудиторная			Внеауди- торная			
						лек.	прак.	лаб.	ПА			КСР
38.03.05 Бизнес- информатика	ОФО	Б1.Б	4	3	73	36	36	0	1	0	35	Э

### Составители(ль)

*Мазелис Л.С., доктор экономических наук, профессор, Кафедра математики и моделирования, lev.mazelis@vvsu.ru*