

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Бианкина Алена Олеговна
Должность: Ректор
Дата подписания: 15.03.2026 18:49:33
Уникальный программный ключ:
b2aeadef209e4ec32d89f812db7eed614bb00b0c

**АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО
ОБРАЗОВАНИЯ**

ИНСТИТУТ СОЦИАЛЬНЫХ НАУК

ДЕПАРТАМЕНТ Экономики, управления, менеджмента и бизнес-информатики

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

«Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов»

Направление подготовки

38.04.01 Экономика

Магистерская программа

Финансовый анализ и оценка инвестиционных решений

Уровень высшего образования

Магистратура

Москва, 2024

ПАСПОРТ

ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов
(наименование дисциплины)

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Индикаторы достижения	Наименование оценочного средства
1.	Основы финансового моделирования	ПК-3. Способен проводить самостоятельные исследования, разработку перспективных методов, моделей и механизмов эффективного функционирования предприятия в соответствии с разработанной программой	Собеседование, контрольная работа, доклад, экзамен
2.	Ценные бумаги как инструмент финансирования предпринимательства.	ПК-3. Способен проводить самостоятельные исследования, разработку перспективных методов, моделей и механизмов эффективного функционирования предприятия в соответствии с разработанной программой	Собеседование, контрольная работа, доклад, экзамен
3.	Моделирование анализа долгосрочных финансовых операций	ПК-1. Способен готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической и экологической политики и принятия стратегических решений на микроуровне	Собеседование, контрольная работа, доклад, экзамен
4.	Моделирование оценки финансовых рисков	ПК-2. Способен составлять прогноз основных социально-экономических и экологических показателей деятельности предприятия	Собеседование, контрольная работа, доклад, экзамен

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для текущего контроля

по дисциплине **«Анализ и финансовое
моделирование инвестиционных проектов»**

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	<i>Собеседование</i>	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний, обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы для обсуждения

ВОПРОСЫ ДЛЯ ОБСУЖДЕНИЯ

1. Сущность и этапы финансового моделирования.
2. Информационное обеспечение финансовых
3. решений.
4. Ценные бумаги как инструмент финансирования предпринимательства.
5. Капитализация рынка ценных бумаг.
6. Фактор времени и оценка поток и платежей.
7. Принцип временной ценности денег.
8. Методы учет фактора времени в финансовых операциях.
9. Оценка потоков платежей.
10. Разработка планов погашения кредита.
11. Природа риска и показатели его измерения.
12. Случайные события.
13. Вероятности.
14. Законы распределения.
15. Автоматизация расчетов показателей рисков.
16. Методы анализа рисков инвестиционных проектов.
17. Метод корректировки нормы дисконта.
18. Метод достоверных эквивалентов.
19. Анализ чувствительности критериев эффективности.
20. Метод сценариев.
21. Анализ вероятности распределения потоков платежей.
22. Деревья решений.

КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ (В РАМКАХ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ)

Критерии оценки ответов на теоретические вопросы:

- *неудовлетворительно* **выставляется студенту, если** дан неполный ответ, представляющий собой разрозненные знания по теме вопроса с существенными ошибками в определениях. Присутствуют фрагментарность, нелогичность изложения. Студент не осознает связь данного понятия, теории, явления с другими объектами дисциплины. Отсутствуют выводы, конкретизация и доказательность изложения. Речь неграмотная. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента не только на поставленный вопрос, но и на другие вопросы дисциплины.

- *удовлетворительно* **выставляется студенту, если** дан недостаточно полный и недостаточно развернутый ответ. Логика и последовательность изложения имеют нарушения. Допущены ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Студент не способен самостоятельно выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. *Студент может конкретизировать обобщенные знания, доказав на примерах их основные положения только с помощью преподавателя. Речевое оформление требует поправок, коррекции.*

- *хорошо* **выставляется студенту, если** дан полный, но недостаточно последовательный ответ на поставленный вопрос, но при этом показано умение выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Ответ логичен и изложен в терминах науки. *Могут быть допущены 1-2 ошибки в определении основных понятий, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.*

- *отлично* **выставляется студенту, если** дан полный, развернутый ответ на поставленный вопрос, показано умение выделить существенные и несущественные признаки, причинно-следственные связи. Ответ четко структурирован, логичен, изложен в терминах науки.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для контроля самостоятельной работы

по дисциплине «Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов»

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	<i>Доклад</i>	Продукт самостоятельной работы студента, представляющий собой публичное выступление по решению определенной учебно-практической, учебно-исследовательской или научной темы	Темы докладов

ТЕМЫ ДОКЛАДОВ

1. Основные понятия и принципы финансового моделирования.
2. Цели и задачи финансового моделирования в бизнесе.
3. Программные средства для финансового моделирования (Excel, специализированные программы).
4. Методы прогнозирования и анализа финансовых данных.
5. Модели оценки рентабельности и рисков инвестиционных проектов.
6. Примеры использования финансовых моделей в реальных проектах.
7. Как финансовое моделирование помогает в составлении и контроле бюджета.
8. Практические примеры бюджетирования с использованием моделей.
9. Влияние финансового моделирования на принятие стратегических решений.
10. Примеры успешного стратегического планирования с помощью моделей.
11. Методы анализа чувствительности.
12. Сценарный анализ и его применение в финансовом планировании.
13. Идентификация и оценка рисков с помощью финансовых моделей.
14. Стратегии управления рисками на основе моделирования.
15. Этические аспекты финансового моделирования.
16. Международные стандарты и лучшие практики.
17. Методы работы с неопределенными данными.
18. Примеры успешного применения в различных отраслях.
19. Влияние новых технологий (Big Data, AI) на финансовое моделирование.
20. Перспективы развития и внедрения инноваций.

КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ (В РАМКАХ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ)

Оценка «отлично» – цель сформулирована, четко обоснована, дан подробный план ее достижения. Тема раскрыта исчерпывающе, автор продемонстрировал глубокие знания. Доклад отличается творческим подходом, собственным оригинальным отношением автора к теме. Печатный вариант доклада полностью соответствует требованиям качества. Отличается четкой структурой и грамотным оформлением. Автору удалось вызвать интерес аудитории и уложиться в регламент.

Оценка «хорошо» – цель сформулирована, обоснована, дан схематичный план ее достижения. Тема доклада раскрыта, автор показал хорошее знание тематики исследования. Работа над докладом была самостоятельная, демонстрирующая серьезную заинтересованность автора, была предпринята попытка представить личный взгляд, применены элементы творчества. Печатный вариант доклада не полностью соответствует требованиям качества. Предприняты попытки оформить работу, придать ей соответствующую структуру. Автору удалось вызвать интерес аудитории, но он вышел за рамки регламента.

Оценка «удовлетворительно» – цель сформулирована, но план ее достижения отсутствует. Тема доклада раскрыта фрагментарно. Автор проявил незначительный интерес к теме доклада, но не продемонстрировал самостоятельности в работе над докладом, не использовал возможности творческого подхода. Печатный вариант доклада не соответствует требованиям качества. Отсутствуют порядок и четкая структура работы. Есть ошибки в оформлении. Материал изложен с учетом регламента, однако автору не удалось заинтересовать аудиторию.

Оценка «неудовлетворительно» – цель не сформулирована. Тема доклада не раскрыта и не исследована. Доклад шаблонный, показывающий формальное отношение автора. Доклад в печатном варианте отсутствует. Презентация не проведена.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для промежуточного контроля

по дисциплине «Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов»

ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	<i>Зачет с оценкой</i>	Итоговая форма оценки знаний	Вопросы к зачету. Комплект билетов к зачету

Вопросы к экзамену по дисциплине «Анализ и финансовое моделирование инвестиционных проектов»

1. Сущность и этапы финансового моделирования.
2. Информационное обеспечение финансовых решений.
3. Программное обеспечение финансовых решений
4. Принцип временной ценности денег
5. Методы учета фактора времени в финансовых операциях
6. Оценка потоков платежей
7. Разработка планов погашения кредита
8. Метод чистой современной стоимости
9. Внутренняя норма доходности
10. Индекс рентабельности проекта
11. Методы оптимизации в инвестиционном анализе
12. Виды лизинговых соглашений
13. Автоматизация расчетов показателей рисков
14. Метод корректировки нормы дисконта
15. Анализ чувствительности критериев эффективности
16. Метод сценариев
17. Анализ вероятности распределения потоков платежей
18. Моделирование рисков инвестиционных проектов
19. Технология имитационного моделирования в среде MS EXCEL
20. Этапы формирования инвестиционного портфеля
21. Оценка риска и доходности портфеля
22. Модели ценообразования активов на рынке капиталов

