

1. Назва. Математичні методи та моделі фінансового менеджменту

2. Шифр. БД 4

3. Тип. Базова

4. Рік навчання. 2019-2020

5. Семестр. I

6. Кількість кредитів ЄКТС - 5.

7. ШБ лектора, науковий ступінь, посада.

Гур'янова Лідія Семенівна, д.е.н., проф., зав. кафедри економічної кібернетики

8. Результати навчання:

здатність здійснювати оцінку і аналіз ефективності і якості функціонування фінансової системи підприємства, розробляти стратегії її сталого розвитку; здатність застосовувати науковий, аналітичний, методичний інструментарій для управління економічною діяльністю.

9. Обов'язкові попередні навчальні дисципліни.

Економіка підприємства, Фінанси, Моделювання економіки, Економетрика, Прогнозування соціально-економічних процесів, Дослідження операцій та методи оптимізації

10. Зміст.

Теоретичні й організаційні основи фінансового менеджменту. Концептуальна модель системи забезпечення фінансового менеджменту. Методи фінансового прогнозування і планування діяльності підприємства. Моделі формування фінансової стратегії підприємства. Система поточного фінансового планування. Система оперативного планування фінансової діяльності. Методи та моделі аналізу фінансових звітів. Методи фінансово-економічного аналізу. Методи багатомірного статистичного аналізу (кластерний аналіз, дискримінантний аналіз, дисперсійний аналіз). Методи рейтингового оцінювання. Методи аналізу часових рядів. Евристичні методи. Методи та моделі управління грошовими потоками на підприємстві. Методи оптимізації грошових потоків. Методи та моделі управління інвестиціями. Методи оцінки ефективності інвестиційних проектів. Методи оцінки ризику інвестиційних проектів. Моделі оцінки фінансових інструментів інвестування. Моделі формування портфеля інвестицій. Методи та моделі управління активами. Методи оцінки вартості активів підприємства. Моделювання вибору стратегії фінансування. Моделі управління виробничими запасами. Методи оптимізації структури капіталу. Методи та моделі управління прибутком. Моделювання операційного левериджу. Методи і моделі управління фінансовими ризиками. Моделі антикризового фінансового управління на підприємстві. Моделі фінансової рівноваги. Моделі стійкого зростання.

11. Рекомендовані джерела.

1.Бланк И.А. Основы финансового менеджмента. Т.1. / И.А. Бланк – К.: Ника-Центр, 2006. – 592с.

2.Бланк И.А. Основы финансового менеджмента. Т.2. / И.А. Бланк – К.: Ника-Центр, 2006. – 512с.

- 3.Ващенко Т. В. Математика фінансового менеджмента / Т.В. Ващенко - М.: Перспектива, 1996. – 80 с.
- 4.Дубина И. Н. Математико-статистические методы в эмпирических социально-экономических исследованиях : учеб. пособие / И. Н. Дубина. – М. : Финансы и статистика; ИНФРА-М. –2010. – 416 с.
- 5.Лук'яненко І.Г., Городніченко Ю.О. Сучасні економетричні методи у фінансах. Навчальний посібник. – К.: Літера ЛТД, 2002. – 352 с.
- 6.Оценка бизнеса: Учебник / Под ред. А.Г. Грязновой, М.А. Федотовой. – М.: Финансы и статистика, 2002. – 512с.
- 7.Терещенко О.О. Фінансова санація та банкрутство підприємств: Навч. посібник / О.О. Терещенко – К.: КНЕУ, 2000. – 412 с.
- 8.Уотшем Т.Дж., Паррамоу К. Количественные методы в финансах: Учеб. пособие для вузов / Пер. с англ. Под ред. Ефимовой М.Р. – М.: Финансы, ЮНИТИ, 1999. – 527с.
- 9.Фінансовий менеджмент: Навчальний посібник: / За ред. проф. Г.Г. Кірейцева. – Київ: ЦУЛ, 2002. – 496с.
- 10.Христиановский В.В., Полшков Ю.Н., Щербина В.П. Экономический риск и методы его измерения. – Донецк: ДонГУ, 1999. – 250с.

12. Методи навчання.

Лекції, лабораторні заняття, лекції проблемного характеру, робота в малих групах, комп'ютерна симуляція, презентації.

13. Методи оцінювання:

- поточний контроль (активна робота на лекційних заняттях, активна участь у виконанні лабораторних завдань, проведення поточних контрольних робіт, виконання індивідуального науково-дослідного завдання);
- модульний контроль (комплексна контрольна робота);
- підсумковий контроль (іспит).

14. Мова навчання. Українська