



(495) 233-05-37

www.finofficer.ru

E-mail: office@finofficer.ru

Семинар / Вебинар
Финансовое моделирование для кредитных специалистов (часть I): прогноз развития корпораций с помощью MS Excel: тренинг на ПК

Программа

День первый.

1. Теоретические основы финансового моделирования 3-х форм прогнозной отчетности.

- Правила грамотной подготовки финансовых моделей и их оптимизации.
- Состав прогнозных отчетов.
- Содержание ключевых строк трех отчетов: прогноз прибылей и убытков, прогноз денежных потоков, прогнозный баланс.
- Последовательность действий при финансовом моделировании.
- Связь трех прогнозных отчетов.

2. Источники информации макроэкономических прогнозов.

- Список российских и зарубежных источников экономических прогнозов.
- Источники отраслевых прогнозов.
- Автоматизация прогнозирования макроэкономических показателей в MS Excel. Применение функций ТЕНДЕНЦИЯ, РОСТ.
- Выбор прогнозов, которые влияют на деятельность корпорации. Функция КОРРЕЛ в MS Excel.
- Построение графиков, отражающих прогнозы, в MS Excel и их исследование для применения в финансовую модель.
- Применение прогнозов в финансовой модели: предикторная модель. Применение функции ЛИНЕЙН для разработки предикторной модели прогнозирования в MS Excel.

Задание с применением ПК: «Формирование макроэкономического прогноза в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Корреляционный выбор прогнозов для применения в финансовой модели в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Прогнозирование выручки на основе макроэкономических прогнозов в MS Excel».

3. Прогнозирование плана прибылей и убытков в MS Excel.

- Способы и модели прогнозирования прибылей и убытков: их отличия, преимущества и недостатки.
- Расчет специальных показателей EBIT, EBITDA.
- Коэффициентное прогнозирование прибылей и убытков в MS Excel.
- Регрессионное прогнозирование прибылей и убытков. Применение в прогнозировании функций СРЗНАЧ, ЛИНЕЙН, ТЕНДЕНЦИЯ и РОСТ в MS Excel.
- Прогнозирование финансовых результатов путем разделения затрат на простые и переменные затраты с помощью MS Excel.
- Настройка автоматизации выбора модели для прогнозирования отчета о прибылях и убытках.
- Анализ точности прогнозов с помощью расчета отклонений исторических данных. Автоматизация программного выбора модели прогнозирования путем применения исторического анализа в MS Excel.
- Применение спинера в MS Excel для «ручного» регулирования финансовых результатов.
- Автоматизация отражения названия строк прогноза: «прибыль», «убыток» в MS Excel.
- Применение функций ОКРУГЛ, ОКРУГЛТ для уточнения расчетов.
- Особенности моделирования компаний с сезонностью. Графический анализ сезонности корпорации в MS Excel.
- Расчет коэффициента сезонности и применение в модели с помощью MS Excel.
- Особенности моделирования компаний с долгосрочными циклами. Уточнение прогнозного отчета о прибылях и убытках в циклическом бизнесе с помощью MS Excel.

Задание с применением ПК: «Создание прогнозной модели отчета о прибылях и убытках в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Создание программы автоматизации выбора модели прогноза отчета о прибылях и убытков в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Создание спинера для "ручного" управления финансовыми результатами в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Анализ сезонных периодов в MS Excel».

4. Прогнозирование оборотного капитала компаний в MS Excel.

- Понятие и расчет оборотного капитала. Цели использования оборотного капитала при моделировании.
- Факторы, влияющие на оборотный капитал. Применение функции КОРРЕЛ для определения факторов оборотного капитала в MS Excel.
- Прогнозирование оборотного капитала и его составляющих с помощью различных моделей: трендовая модель, регрессионная модель, модель

финансового цикла с применением MS Excel.

- Выбор моделей, автоматизация выбора модели прогнозирования оборотного капитала в MS Excel.

Задание с применением ПК: «Создание модели прогнозирования оборотных активов в MS Excel».

День второй.

5. Прогнозирование денежного потока прямым и косвенными методами в MS Excel.

- Факторы, влияющие на денежные потоки. Анализ зависимости отдельных строк отчета о движении денежных средств от влияющих факторов. Выбор влияющих факторов с помощью функции КОРРЕЛ в MS Excel.
- Построение модели прогнозирования денежного потока от операционной деятельности прямым методом. Применение для прогнозирования коэффициентного метода и функций СРЗНАЧ, ЛИНЕЙН, ТЕНДЕНЦИЯ и РОСТ в MS Excel.
- Особенности сезонных и циклических бизнесов для построения финансовой модели отчета о движении денежных средств.
- Построение модели прогнозирования денежного потока от операционной деятельности косвенным методом в MS Excel.
- Построение прогнозов инвестиционной деятельности: проектный метод, амортизационный метод, метод трендов в MS Excel.
- Построение прогнозов финансовой деятельности в MS Excel. Отделение в прогнозе разделов финансирования отдельного банка.
- Контроль за остатками денежных средств с помощью функций ЕСЛИ и функцией «Условное форматирование».

Задание с применением ПК «Прогнозирование операционной деятельности в формате прямого метода».

Задание с применением ПК: «Прогнозирование операционной деятельности в формате косвенного метода в MS Excel».

6. Моделирование кредитов с помощью MS Excel.

- Правила построения таблиц-графиков банковского кредитования с помощью MS Excel.
- Теоретические основы финансовых расчетов. Эффективная процентная ставка. Аннуитет. Методы начисления. Временная база расчета.
- Практическое применение спектра функций для исчисления кредитных платежей, процентных ставок, процентов и остатков: СТЕПЕНЬ, ПЛТ,

ОСПЛТ, ПРПЛТ, ПРОЦПЛАТ, ОБЩПЛАТ, ПС, БС, ЧПС, ЧИСТНЗ, ВСД, ЧИСТВНДОХ, НОМИНАЛ, ЭФФЕКТ в программе MS Excel.

- Процентный формат в MS Excel.
- Применение функции ЕСЛИ для останова расчета процентов и возврата кредита в MS Excel.
- Особенности построения графиков кредитования при револьверных кредитных линиях в MS Excel.
- Оптимизационное моделирование: цели, задачи, ограничение, понятие экстремума функции.
- Подбор кредитных условия для клиента с помощью надстройки «Поиск решения» в MS Excel.

Задание с применением ПК: «Построение план-графиков кредитования в MS Excel».

Задание с применением ПК: «Подбор схемы кредитования по заданным условиям в MS Excel».

7. Составление прогнозного баланса в MS Excel.

- Подходы к прогнозированию статей баланса: коэффициентный метод, трендовый метод, экспертный метод, некорреляционный метод в MS Excel.
- Особенности прогнозирования внеоборотных активов, в т.ч. применение амортизационного метода в MS Excel.
- Особенности прогнозирования оборотного капитала в MS Excel.
- Особенности прогнозирования дивидендов и накопленной прибыли в MS Excel.
- Включение остатков кредитов и займов из модели кредитов в MS Excel.
- Отдельные «нестандартные» статьи и их прогнозирование: отложенные налоги, НДС, оценочные обязательства, прочие активы и обязательства в MS Excel.
- Проблемы балансировки прогнозного баланса и способы их решения с помощью MS Excel.
- Комплексное моделирование прогнозного баланса в MS Excel.

Задание с применением ПК: «Составление прогнозного баланса корпорации в MS Excel».

8. Ситуационный анализ при финансовом моделировании корпорации с помощью MS Excel.

- Теоретический аспект ситуационного анализа. Моделирование ситуаций подходом Монте-Карло.
- Применение функций СЛЧИС и СЛУЧМЕЖДУ для моделирования случайного события в MS Excel. Ограничения на применение в MS Excel данных функций.

- Применение функции «Генерация случайных чисел» из надстройки «Анализ данных» в MS Excel.
- Изучение изменений модели при ситуационном анализе. Анализ чувствительности прогнозов в MS Excel.

Задание с применением ПК: «Построение финансовой модели для ситуационного анализа в программе MS Excel».

Задание с применением ПК: «Анализ чувствительности в MS Excel».

Слушатели обеспечиваются учебным пособием.

Количество часов: 16 ак. часов

Место проведения: г. Москва, ул. Рабочая, д. 35 (м. Римская, м. Площадь Ильича)

Стоимость участия: 37500 руб. / 1 слушатель.

Постоянным слушателям – скидки.

При записи нескольких слушателей – скидки.

Ближайшая дата: По мере набора группы. Уточняйте информацию у менеджеров.