

# Финансовое моделирование I: техника разработки моделей и возможности MS Excel

Академия бизнеса EY

2 дня | 16 академических часов

12 CPD-единиц | 14 CPE-часов

## Программа тренинга

### День 1

#### Цели и правила моделирования

- ▶ Цели финансового моделирования и прогнозирования, область применения моделей
- ▶ Основные стадии разработки модели: планирование, построение, тестирование, применение
- ▶ «Золотые правила» моделирования

#### Моделирование операционных решений

- ▶ Оценка характера поведения затрат. Регрессионный анализ
- ▶ Функции SLOPE, INTERCEPT и RSQ
- ▶ Практический кейс: Выделение из состава общих затрат переменных и постоянных затрат с помощью функций регрессионного анализа: функции SLOPE, INTERCEPT, RSQ
- ▶ Применение функций TREND, FORECAST

#### Прогнозирование затрат

- ▶ Оценка чувствительности прибыли к изменению рыночных условий. Факторный анализ
- ▶ Функция Data Table
- ▶ Практический кейс: Анализ чувствительности результатов к изменению исходных данных с помощью функции Data Table
- ▶ Анализ рентабельности капитала (ROCE, ROE). Анализ сценариев. Поиск целевых значений.
- ▶ Функции Scenario Manager, Goal Seek
- ▶ Практический кейс: Анализ сценариев эффекта финансового рычага с помощью функции Scenario Manager

- ▶ Практический кейс: Подбор значений параметров для достижения целевого значения результата помощью функции Goal Seek (подбор параметра)

### День 2

- ▶ Решение оптимизационных задач: оптимизация ассортимента, расписаний, портфеля инвестиций, маршрутов. Техника поиска оптимальных решений.
- ▶ Функция SOLVER
- ▶ Практический кейс: Решение нескольких оптимизационных задач с помощью функций SOLVER

#### Моделирование инвестиционных решений

- ▶ Техника принятия инвестиционных решений. Техника дисконтирования и компаундирования.
- ▶ Функции PV, FV, PMT
- ▶ Практический кейс: Принятие инвестиционных решений с помощью функций PV, FV, PMT
- ▶ Основные финансовые индикаторы оценки инвестиционных проектов
- ▶ Функции NPV, IRR, XNPV, XIRR
- ▶ Практический кейс: Оценка инвестиционных проектов с помощью функций NPV, IRR, XNPV, XIRR
- ▶ Инструмент управления данными Spinner. Многовариантность расчетов в модели. Функции IF и CHOOSE
- ▶ Практический кейс: задание многовариантности расчетов в модели с помощью инструмента управления Spinner, функций IF и CHOOSE

## Цели обучения

- ▶ Узнать правила построения финансовых моделей для обеспечения их логичности, структурированности, прозрачности и пригодности для тестирования
- ▶ Выработать навык применения полезных функций MS Excel в финансовых моделях
- ▶ Научиться эффективно анализировать результаты расчетов и находить целевые значения и оптимальные решения
- ▶ Разрабатывать модели с многовариантностью расчетов



Совершенствуя бизнес,  
улучшаем мир



## Что вы получите в результате обучения

- ▶ 10 «Золотых» правил моделирования, разработанных на основе лучших практик и позволяющих минимизировать количество ошибок в модели, а также упростить ее тестирование
- ▶ Принципы построения моделей для принятия операционных и инвестиционных решений
- ▶ 20+ стандартных функций MS Excel, без которых нельзя построить финансовую модель
- ▶ 5+ необходимых инструментов для построения и проверки финансовых моделей
- ▶ Специально разработанные материалы тренинга, в том числе файлы MS Excel с заданиями и ответами
- ▶ Профессиональные рекомендации от тренера-эксперта
- ▶ Сертификат Академии бизнеса EY

## Как проходит обучение

- ▶ Тренинг «финансовое моделирование» сочетает лекционный формат и практические задания, которые выполняются на персональных компьютерах
- ▶ В качестве инструмента моделирования используется MS Excel с набором стандартных функций и макросов (русифицированные и нерусифицированные версии программы)
- ▶ Теоретический материал тренинга (предмет моделирования) освещает такие понятия, как точка безубыточности, финансовый рычаг, комбинированный рычаг, рентабельность капитала, показатели эффективности инвестиционных проектов
- ▶ Не менее 70% времени посвящено выполнению практических заданий
- ▶ Участники получают свои рабочие файлы MS Excel, а также ответы Академии бизнеса EY после тренинга

## Тренеры

Тренинг проводит бизнес-тренер команды Академии бизнеса EY. Тренеры обладают богатым практическим опытом, а также международными квалификациями CIA, ACCA, CMA, CIRM, CFA, PMP и др.

Запросить CV тренера и задать вопросы о тренинге: [academy@kz.ey.com](mailto:academy@kz.ey.com)

## Для кого этот тренинг

Сотрудники и руководители любых направлений бизнеса, в том числе HR, маркетинг, логистика, финансы, которые принимают операционные и инвестиционные решения и ищут пути оптимизации своей деятельности (от оптимизации ассортимента до минимизации расходов)

## Форматы участия

### Открытый формат

Тренинг проводится в соответствии с расписанием Академии бизнеса EY с 10:00 до 17.00 с перерывом на обед и 2 кофе-брейками.

### Корпоративный формат

Программа может быть адаптирована и проведена специально для Вашей компании:

- ▶ Предварительный анализ потребностей в обучении, определение целей и задач
- ▶ Адаптация тренинга с учетом отраслевой специфики
- ▶ Гибкий подход к выбору места, сроков и времени проведения тренингов
- ▶ Отчет о результатах обучения по запросу клиента.