



Аудит и подготовка финансовой модели для имитационного моделирования

Февраль 2022

**RISK
AWARENESS
WEEK 2022**

**ЗИМНЯЯ СЕССИЯ
АНО ДПО "ИСАР"**

Зимняя сессия это уникальная возможность для обмена практическим опытом внедрения инструментов количественной оценки рисков для решения важных бизнес задач

WINTER.RISKWARENESSWEEK.COM



Константин Дождиков
Ph.D., CRMP.RR, CT31000

- Более 20 лет практики управления рисками, корпоративных финансах, финансовом моделировании, бизнес-планировании, оценке бизнеса,
- Со-основатель и руководитель направления АНО ДПО «ИСАР»
- Член наблюдательного совета Гильдии инвестиционных и финансовых аналитиков
- Опыт консультирования/внедрение управления рисками в отраслях: нефть и газ, лизинг, авиа-транспорт, телекоммуникации, инвестиционные фонды, страхование.
- Автор курсов по управлению рисками (НИУ ВШЭ, РАНХиГС, корп. институты и др.).
- Со-автор 2 книг по риск-менеджменту

Финансовая модель - это математическое представление финансовых операций и финансовой отчетности компании. Она используется для прогнозирования будущих финансовых результатов компании на основе ключевых допущений.



Имитационная модель – моделирует множество возможных сценариев и оценивает влияние заданных рисков (возможных изменений исходных параметров) на конечный результат, а также позволяет определить те риски / исходные параметры, которые оказывают наибольшее влияние на итоговый результат.



Шаги создания имитационной модели

Постановка целей и задач моделирования

Проверка (аудит) и подготовка существующей финансовой модели

Определение выходных факторов ModelRisk

Определение входных факторов и их распределений

Определение корреляция риск-факторов

Установка количества итераций и имитаций

Запуск имитационного моделирования

Формирование выводов для менеджмента

Достижимость КПЭ

Реализуемость стратегии

Взвешивание альтернатив с учетом рисков

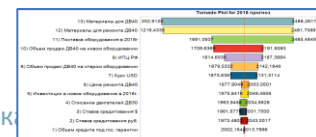
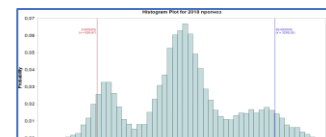
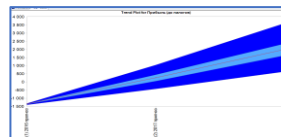
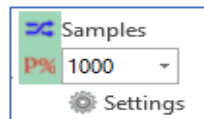
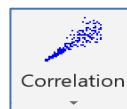
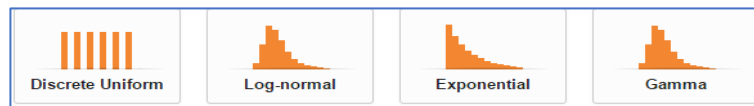
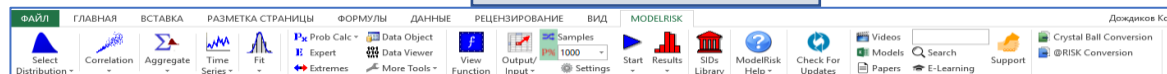
\$

Выручка

Затраты

Profit and loss

Cash flow



Проверка (аудит) и подготовка существующей финансовой модели

1. Размер модели и ее содержание
2. Параметры вычислений и время вычислений
3. Ссылки на другие файлы и «ломанные ссылки»
4. Список имен и ошибочных ссылок имен
5. Ошибки вычислений (#ДЕЛ/0! и другие)
6. Изменения формул в строке
7. Неправильные знаки (входные данные, расчеты, выходные формы)
8. Найти все вводные параметры
9. Анализ итоговых результатов:
 - Корректность работы формул
 - Корректность логики
10. Подготовка шаблона отдельного листа «Риск факторы»



Спасибо за внимание!

Вопросы?

Статьи, шаблоны и исследования

www.risk-academy.ru

Free risk management book

www.researchgate.net/publication/323254437_GUIDE_TO_EFFECTIVE_RISK_MANAGEMENT_30

Наш YouTube канал

<https://www.youtube.com/channel/UCog9jkDZdiRps2w27MZ5Azg>

