

Міністерство освіти і науки України
Бурштинський енергетичний коледж Івано-Франківського національного
технічного університету нафти і газу

ЗАТВЕРДЖУЮ
директор коледжу ІФНТУНГ

_____ О.Д.Джура

«__» серпня 2010р

НАВЧАЛЬНА ПРОГРАМА

з дисципліни «Методи і моделі оцінювання»

напряму підготовки 5.03050802 «Оціночна діяльність»

Підготував викладач:

О.Л.Пархуць

Програма з дисципліни «Методи і моделі оцінювання» розроблена згідно з стандартом вищої освіти для навчальних закладів II-го рівня акредитації.

Укладач: Пархуць О.Л., викладач Бурштинського енергетичного коледжу Івано-Франківського національного технічного університету нафти і газу.

Програма обговорена і
схвалена на засіданні
циклової комісії економічних
дисциплін
Протокол № 1
від «__» _____ 20 р.
Голова циклової комісії:
_____ М.М.Шувар

ЗМІСТ ПРОГРАМИ

Тема 1. Порівняння як метод оцінювання.

- 1.1. Загальна характеристика порівняльного підходу
- 1.2. Переваги та недоліки підходу

Тема 2. Подібність об'єктів та порівнянні дані

- 2.1. Загальні методи пізнання.
- 2.2. Метод порівняння
- 2.3. Методи, що застосовуються на емпіричному та теоретичному рівнях досліджень.
- 2.4. Характеристика елементів порівняння майна

Тема 3. Техніка коригувань

- 3.1. Коригування даних про об'єкти аналогії.
- 3.2. Особливості використання порівняльних методів.

Тема 4. Техніка прямої капіталізації

- 4.1. Метод прямої капіталізації доходу
- 4.2. Методи розрахунку ставки капіталізації
- 4.3. Обґрунтування капіталізації прибутку
- 4.4. Прирівнювання коефіцієнта капіталізації до ставки дисконту

Тема 5. Моделі залишкової капіталізації

- 5.1. Метод залишку
- 5.2. Моделі розрахунку рівняння залишкової капіталізації
- 5.3. Варіанти практичного використання базового рівняння

Тема 6. Витратний метод оцінювання майна

- 6.1. Характеристика витратного підходу. Сфера застосування.
- 6.2. Методи розрахунку вартості відтворення та заміщення
- 6.3. Визначення зносу об'єктів нерухомості.

Тема 7. Метод капіталізації доходу

- 7.1. Сутність дохідного підходу, сфера його застосування.
- 7.2. Метод дисконтування грошових потоків.

Тема 8. Імітаційні моделі

- 8.1. Поняття імітаційного моделювання
- 8.2. Основні аспекти імітаційного моделювання
- 8.3. Теоретичні основи методу статистичного моделювання
 - 8.3.1. Моделювання випадкових величин
 - 8.3.2. Моделювання випадкових подій
- 8.4. Послідовність створення математичних імітаційних моделей

8.5. Моделювання випадкових величин як системотвірної імітаційного процесу моделювання

8.6. Приклади імітаційного моделювання

Тема 9. Стратифікація, факторний і кластерний аналіз

9.1. Теорія соціальної стратифікації

9.2. Опис інформації та обчислення узагальнюючих параметрів

9.3. Методи багатовимірної статистики: факторний і кластерний аналіз

Тема 10. Математичні та статистичні методи оцінювання

10.1. Математичні методи оцінювання.

10.2. Статистичні методи оцінювання

Тема 11. Оцінювання окремих видів активів

11.1. Методичні основи оцінки інвестиційних проектів

11.2. Основні методи оцінки привабливості інвестицій

Тема 12. Методи і моделі оцінювання нерухомого майна

12.1. Основні показники класифікаційної характеристики будівель споруд та їх зносу

12.2. Методичні основи оцінки затратним методом

12.3. методичні основи прямого порівняльного аналізу продаж.

12.4. Методи оцінки житлової нерухомості

Тема 13. Оцінювання землі

13.1. Призначення та функції оцінки землі

13.2. Міські землі як товар та об'єкт оцінки

13.3. Нормативна ціна й ринкова вартість

13.4. Визначення базової вартості міських земель

13.5. Основні принципи та методи експертної оцінки землі

Тема 14. Методи і моделі оцінювання рухомого майна

14.1. Методичні основи оцінки машин та обладнання

14.2. Оцінка серійного виробничого обладнання

14.3. Методи і моделі оцінювання автотранспорту.

Тема 15. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності

15.1. Поняття оцінки бізнесу.

15.2. Особливості бізнесу як об'єкта оцінки

15.3. Необхідність та мета оцінки бізнесу

15.4. Загально визнані методи оцінки вартості бізнесу

15.5. Оцінка вартості на основі активів

15.6. Оцінка вартості на основі використання дохідного підходу

15.7. Форми інтелектуальної власності

15.7. Методи і моделі оцінювання інтелектуальної власності

Семестр	Назва розділів, тем, зміст заняття	Вид заняття	Обсяг навчальних аудиторних годин самостійних	Форма контролю	Основні вимоги до знань і умінь з даної теми програми	Література
1	2	3	4	5	6	7
	<p>Тема 1. Порівняння як метод оцінювання.</p> <p>1.1. Загальна характеристика порівняльного підходу</p> <p>1.2. Переваги та недоліки підходу</p>	Лекція самост	2 4	Бесіда	<p><i>Знати:</i> загальну характеристику порівняльного підходу, переваги та недоліки;</p> <p><i>Вміти:</i> розрахувати оціночну вартість за допомогою порівняльного підходу</p>	/1. Т 7; 2. Р9.1./
	<p>Тема 2. Подібність об'єктів та порівнянні дані</p> <p>2.1. Загальні методи пізнання.</p> <p>2.2. Метод порівняння</p> <p>2.3. Методи, що застосовуються на емпіричному та теоретичному рівнях досліджень.</p> <p>2.4. Характеристика елементів порівняння майна</p>	Самост	6		<p><i>Знати:</i> загальні методи пізнання</p> <p><i>Вміти:</i>характеризувати елементи порівняння майна</p>	/Інтернет/
	<p>Тема 3.Техніка коригувань</p> <p>3.1. Коригування даних про об'єкти аналогії.</p> <p>3.2. Особливості використання порівняльних методів</p>	Лекція самост	2 4	бесіда	<p><i>Знати:</i> особливості використання порівняльних методів</p> <p><i>Вміти:</i> коригувати дані про об'єкти аналогії.</p>	/1. Т7.2. 2,Р 9. 3-9.4 /
	Семінарське заняття №1. Порівняння як метод	семінар	2	Фронт опит		

	оцінювання. Подібність об'єктів та порівнянні дані. Техніка коригувань.					
	Тема 4. Техніка прямої капіталізації 4.1. Метод прямої капіталізації доходу 4.2. Методи розрахунку ставки капіталізації 4.3. Обґрунтування капіталізації прибутку 4.4. Прирівнювання коефіцієнта капіталізації до ставки дисконту	Сам.	4		<i>Знати:</i> методи розрахунку ставки капіталізації <i>Вміти:</i> визначати вартість об'єктів власності методом прямої капіталізації	/1.ст. 76-80 2. ст. 228-233/
	Тема 5. Моделі залишкової капіталізації 5.1. Метод залишку 5.2. Моделі розрахунку рівняння залишкової капіталізації 5.3. Варіанти практичного використання базового рівняння	Лекція	2	бесіда	<i>Знати:</i> моделі розрахунку рівняння залишкової капіталізації <i>Вміти:</i> практично використовувати базове рівняння	/2.ст. 265-269/
		самост	4			
	Тема 6. Витратний метод оцінювання майна 6.1. Характеристика витратного підходу. Сфера застосування. 6.2. Методи розрахунку вартості відтворення та заміщення 6.3. Визначення зносу об'єктів нерухомості.	Лекція	2	бесіда	<i>Знати:</i> види вартостей, функції вартості. <i>Вміти:</i> відрізнити окремі види вартості, виявити вплив факторів на вартість об'єкта оцінки та скорегувати вартість об'єкту у відповідному напрямку	/1. Т 4, 5 ст. 61-65/
		самост	4			

	Семінарське заняття №2. Техніка прямої капіталізації. Моделі залишкової капіталізації. Витратний метод оцінювання майна.	Сем.	2	Фрон. опит.		
	Тема 7. Метод капіталізації доходу 7.1. Сутність дохідного підходу, сфера його застосування. 7.2. Метод дисконтування грошових потоків.	Лекція Сам.	2 4	Бесіда	<i>Знати:</i> сутність дохідного підходу, сфера його застосування. <i>Вміти:</i> розрахувувати вартість майна методом дисконтованих грошових потоків	/1. ст.74-76, 80-82; 3 ст.13 9-146/
	Практичне заняття №1. Метод капіталізації доходу	практ	2	розв'язування задач		
	Тема 8. Імітаційні моделі 8.1. Поняття імітаційного моделювання 8.2. Основні аспекти імітаційного моделювання 8.3. Теоретичні основи методу статистичного моделювання 8.3.1. Моделювання випадкових величин 8.3.2. Моделювання випадкових подій 8.4. Послідовність створення математичних імітаційних моделей 8.5. Моделювання випадкових величин як системотвірна імітаційного процесу моделювання 8.6. Приклади імітаційного моделювання	Лекція самоств	2 4	Бесіда	<i>Знати:</i> основні аспекти імітаційного моделювання <i>Вміти:</i>	/інтернет/
	Тема 9. Стратифікація, факторний і кластерний	лекція	2	Бесіда	<i>Знати:</i> поняття	/інтернет/

	аналіз. 9.1. Теорія соціальної стратифікації 9.2. Опис інформації та обчислення узагальнюючих параметрів 9.3. Методи багатовимірної статистики: факторний і кластерний аналіз	самост	4		стратифікації, факторний і кластерний аналіз <i>Вміти:</i> застосувати методи багатовимірної статистики при оцінці об'єктів власності	
	Семінарське заняття №3 Метод капіталізації доходу. Імітаційні моделі. Стратифікація, факторний і кластерний аналіз.	семінар	2	Фронт опит.		
	Тема 10. Математичні та статистичні методи оцінювання 10.1. Математичні методи оцінювання. 10.2. Статистичні методи оцінювання	самост	4	Бесіда	<i>Знати:</i> математичні та статистичні методи оцінювання <i>Вміти:</i> застосовувати дані методи при оцінці	/ /
	Тема 11. Оцінювання окремих видів активів 11.1. Методичні основи оцінки інвестиційних проєктів 11.2. Основні методи оцінки привабливості інвестицій	лекція самост	2 4	Бесіда	<i>Знати:</i> методичні основи оцінки інвестиційних проєктів <i>Вміти:</i> оцінювати вартість інвестицій.	/3. Т. 9/
	Тема 12. Методи і моделі оцінювання нерухомого майна 12.1. Основні показники класифікаційної характеристики будівель споруд та їх зносу 12.2. Методичні основи оцінки затратним методом 12.3. Методичні основи прямого порівняльного аналізу продаж.	лекція самост	2 5	Бесіда	<i>Знати:</i> методи і моделі оцінювання нерухомого майна <i>Вміти:</i> оцінювати нерухомість різними методичними підходами	/3. Т 4. /

<p>Тема 15. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності 15.1. Поняття оцінки бізнесу. 15.2. Особливості бізнесу як об'єкта оцінки 15.3. Необхідність та мета оцінки бізнесу 15.4. Загальновизнані методи оцінки вартості бізнесу 15.5. Оцінка вартості на основі активів 15.6. Оцінка вартості на основі використання дохідного підходу 15.7. Форми інтелектуальної власності 15.8. Методи і моделі оцінювання інтелектуальної власності</p>	<p>лекція</p> <p>самост</p>	<p>2</p> <p>6</p>	<p>Бесіда</p>	<p><i>Знати:</i>. місце нематеріальних активів, їх вплив на вартість підприємства, методи оцінки нематеріальних активів. <i>Вміти:</i> визначати вартості нематеріальних активів витратним та дохідним методами і з урахуванням надприбутку</p>	<p>/1. Т 11; 3. ст.12 9-155./</p>
<p>Практичне заняття №3. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності</p>	<p>практ.</p>	<p>2</p>			
<p>Семінарське заняття №5. Оцінювання землі. Методи і моделі оцінювання рухомого майна. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності</p>	<p>семінар</p>	<p>4</p>	<p>тести, опит.</p>		

АНОТАЦІЯ ДИСЦИПЛІНИ «МЕТОДИ І МОДЕЛІ ОЦІНЮВАННЯ»

Мета: надання знань з методології та інструментарію побудови економіко-математичних і статистичних моделей для практичного здійснення оціночної діяльності.

Завдання: вивчення теорії та набуття вмінь аналізу, моделювання і прогнозування розвитку об'єктів оцінювання на макро- та мікроекономічному рівнях.

Предмет: методологія економіко-математичного і статистичного моделювання та інструментарій аналізу процесів, які є складовими оціночної діяльності

Зміст дисципліни розкривається в темах:

1. Порівняння як метод оцінювання.
2. Подібність об'єктів та порівняні дані
3. Техніка коригувань.
4. Техніка прямої капіталізації.
5. Моделі залишкової капіталізації.
6. Витратний метод оцінювання майна.
7. Метод капіталізації доходу.
8. Імітаційні моделі.
9. Стратифікація, факторний і кластерний аналіз.
10. Математичні та статистичні методи оцінювання.
11. Оцінювання окремих видів активів.
12. Методи і моделі оцінювання нерухомого майна.
13. Оцінювання землі.
14. Методи і моделі оцінювання рухомого майна.
15. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності.

Орієнтовний тематичний план

Назва теми	Всього годин	В тому числі				Самостійні
		Аудиторні				
		Разом	В тому числі			
			Лекційні	Семінарські	Практичні	
1	2	3	4	5	6	7
Тема 1. Порівняння як метод оцінювання.	6	2	2			4
Тема 2. Подібність об'єктів та порівняні дані	6					6
Тема 3. Техніка коригувань	8	4	2	2		4
Тема 4. Техніка прямої капіталізації	4					4
Тема 5. Моделі залишкової капіталізації.	6	2	2			4
Тема 6. Витратний метод оцінювання майна	8	4	2	2		4
Тема 7. Метод капіталізації доходу	8	4	2		2	4
Тема 8. Імітаційні моделі	6	2	2			4
Тема 9. Стратифікація, факторний і кластерний аналіз.	8	4	2	2		4
Тема 10. Математичні та статистичні методи оцінювання.	4					4
Тема 11. Оцінювання окремих видів активів.	6	2	2			4
Тема 12. Методи і моделі оцінювання нерухомого майна	11	6	2	2	2	5
Тема 13. Оцінювання землі.	8	2	2			6
Тема 14. Методи і моделі оцінювання рухомого майна	7	1	1			6
Тема 15. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності	12	6	2	2	2	6
Всього:	108	39	23	10	6	69

Міністерство освіти і науки України
Бурштинський енергетичний коледж Івано-Франківського національного
технічного університету нафти і газу

ЗАТВЕРДЖУЮ
Заступник директора
з навчальної роботи
_____ В.В.Остапенко

«___» серпня 20__ р

МЕТОДИЧНІ ВКАЗІВКИ

**ДЛЯ САМОСТІЙНОГО ОПРАЦЮВАННЯ
СТУДЕНТАМИ МАТЕРІАЛУ**

З ДИСЦИПЛІНИ «МЕТОДИ І МОДЕЛІ ОЦІНЮВАННЯ»

освітньо-кваліфікаційного рівня молодший спеціаліст
напряму підготовки: 5.03050802 «Оціночна діяльність»

Програма
самостійного вивчення з навчальної дисципліни:
«Методи і моделі оцінювання»

Назва теми	Кількість годин
1	2
Тема 1. Порівняння як метод оцінювання.	4
Тема 2. Подібність об'єктів та порівняні дані	6
Тема 3. Техніка коригувань	4
Тема 4. Техніка прямої капіталізації	4
Тема 5. Моделі залишкової капіталізації.	4
Тема 6. Витратний метод оцінювання майна	4
Тема 7. Метод капіталізації доходу	4
Тема 8. Імітаційні моделі	4
Тема 9. Стратифікація, факторний і кластерний аналіз.	4
Тема 10. Математичні та статистичні методи оцінювання.	4
Тема 11. Оцінювання окремих видів активів.	4
Тема 12. Методи і моделі оцінювання нерухомого майна	5
Тема 13. Оцінювання землі.	6
Тема 14. Методи і моделі оцінювання рухомого майна	6
Тема 15. Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності	6
Всього:	69

Тема 1

Порівняння як метод оцінювання.

1.2. Переваги та недоліки підходу

Студент повинен знати : загальну характеристику порівняльного підходу, переваги та недоліки

Вміти: розраховувати оціночну вартість за допомогою порівняльного підходу

Література: /1. Т 7; 2. Р9.1./

Тема 2

Подібність об'єктів та порівнянні дані

2.3. Методи, що застосовуються на емпіричному та теоретичному рівнях досліджень.

2.4. Характеристика елементів порівняння майна

Студент повинен знати : загальні методи пізнання

Вміти: характеризувати елементи порівняння майна

Література: /Интернет/

Тема 3

Техніка коригувань

3.2. Особливості використання порівняльних методів

Студент повинен знати : особливості використання порівняльних методів

Вміти : коригувати дані про об'єкти аналогії.

Література: /1. Т7.2. 2,Р 9. 3-9.4 /

Тема 4

Техніка прямої капіталізації

4.3. Обґрунтування капіталізації прибутку

4.4. Прирівнювання коефіцієнта капіталізації до ставки дисконту

Студент повинен знати : методи розрахунку ставки капіталізації

Вміти: визначати вартість об'єктів власності методом прямої капіталізації

Література: /1.ст. 76-80 2. ст. 228-233/

Тема 5

Моделі залишкової капіталізації

5.3. Варіанти практичного використання базового рівняння

Студент повинен знати : моделі розрахунку рівняння залишкової капіталізації

Вміти: практично використовувати базове рівняння

Література: /2. ст. 265-269/

Тема 6

Витратний метод оцінювання майна

6.3. Визначення зносу об'єктів нерухомості.

Студент повинен знати : види вартостей, функції вартості

Вміти: відрізнити окремі види вартості, виявити вплив факторів на вартість об'єкта оцінки та скорегувати вартість об'єкту у відповідному напрямку, визначати знос об'єктів нерухомості

Література: /1. Т 4, 5 ст. 61-65/

Тема 7

Метод капіталізації доходу

7.2. Метод дисконтування грошових потоків.

Студент повинен знати : сутність дохідного підходу, сфера його застосування.

Вміти: розраховувати вартість майна методом дисконтованих грошових потоків

Література: /1. ст.74-76, 80-82; 3 ст.139-146/

Тема 8

Імітаційні моделі

8.4. Послідовність створення математичних імітаційних моделей

8.5. Моделювання випадкових величин як системотвірних імітаційного процесу моделювання

8.6. Приклади імітаційного моделювання

Студент повинен знати : основні аспекти імітаційного моделювання

Вміти: складати імітаційні моделі

Література: /інтернет/

Тема 9

Стратифікація, факторний і кластерний аналіз

9.3. Методи багатовимірної статистики: факторний і кластерний аналіз

Студент повинен знати : поняття стратифікації, факторний і кластерний аналіз

Вміти: застосовувати методи багатовимірної статистики при оцінці об'єктів власності

Література: /інтернет/

Тема 10

Математичні та статистичні методи оцінювання

10.2. Статистичні методи оцінювання

Студент повинен знати : математичні та статистичні методи оцінювання

Вміти: застосовувати дані методи при оцінці

Література: /інтернет/

Тема 11

Оцінювання окремих видів активів

11.2. Основні методи оцінки привабливості інвестицій

Студент повинен знати : методичні основи оцінки інвестиційних проектів

Вміти: оцінювати вартість інвестицій.

Література: /3. Т. 9/

Тема 12

Методи і моделі оцінювання нерухомого майна

12.3. Методичні основи прямого порівняльного аналізу продаж.

12.4. Методи оцінки житлової нерухомості

Студент повинен знати : методи і моделі оцінювання нерухомого майна

Вміти: оцінювати нерухомість різними методичними підходами використовуючи відповідні моделі

Література: /3.Т 4. /

Тема 13

Оцінювання землі

13.4. Визначення базової вартості міських земель

13.5. Основні принципи та методи експертної оцінки землі

Студент повинен знати : загальні положення та принципи експертної оцінки землі

Вміти: організувати процес оцінки, визначати найефективніший варіант використання земельної ділянки, виявити доцільність використання конкретних методів.

Література: /1Т10. 4 Р 4.3 /

Тема 14

Методи і моделі оцінювання рухомого майна

14.3. Методи і моделі оцінювання автотранспорту.

Студент повинен знати : методичні основи оцінки машин та обладнання

Вміти: оцінювати рухоме майно

Література: /3 Т 5/

Тема 15

Методи і моделі оцінювання бізнесу та інтелектуальної власності

15.7. Форми інтелектуальної власності

15.8. Методи і моделі оцінювання інтелектуальної власності

Студент повинен знати : місце нематеріальних активів, їх вплив на вартість підприємства, методи оцінки нематеріальних активів.

Вміти: визначати вартості нематеріальних активів витратним та дохідним методами і з урахуванням надприбутку

Література: /1. Т 11; 3. ст.129-155./