

Министерство науки и высшего образования РФ  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»  
**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Б1.В.ДВ.09.02 Инвестиционный анализ

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.05.01 ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ

Направленность (профиль)

38.05.01.01 Экономико-правовое обеспечение экономической  
безопасности

Форма обучения

очная

Год набора

2018

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Программу составили \_\_\_\_\_

Канд. тех. наук, Доцент, Зиненко Анна Викторовна

должность, инициалы, фамилия

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

Предметом изучения настоящего курса являются реальные и финансовые инвестиции, методы оценки эффективности инвестиционных проектов, модели формирования оптимального инвестиционного портфеля, модели оценки доходности и риска ценных бумаг и срочных контрактов.

Целью дисциплины «Инвестиционный анализ» является изучение методов анализа эффективности инвестиционных проектов, понимание особенностей анализа различных видов инвестиций, получение навыков формирования и анализа инвестиционного портфеля, а также формирование компетенций, которые позволят принимать аналитически обоснованные инвестиционные решения.

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

- изучить методы экономической оценки реальных инвестиций, а также оценки инвестиционных рисков;
- рассмотреть инструменты финансовых инвестиций и изучить методы их оценки;
- изучить методы формирования и анализа инвестиционного портфеля;
- привить студентам практические навыки инвестирования.

### 1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
	<b>ПК-1: способностью подготавливать исходные данные, необходимые для расчета экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов</b>
	<b>ПК-2: способностью обосновывать выбор методик расчета экономических показателей</b>
	<b>ПК-3: способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов</b>
	<b>ПК-5: способностью осуществлять планово-отчетную работу организации, разработку проектных решений, разделов текущих и перспективных планов экономического развития организации, бизнес-планов, смет, учетно-отчетной документации, нормативов затрат и соответствующих предложений по реализации разработанных проектов, планов, программ</b>

### 1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется с применением ЭО и ДОТ

URL-адрес и название электронного обучающего курса: (<https://e.sfu-kras.ru/course/view.php?id=29500>).

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	е
		1
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>0,78 (28)</b>	
занятия лекционного типа	0,39 (14)	
практические занятия	0,39 (14)	
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>1,22 (44)</b>	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

#### 3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

		Контактная работа, ак. час.							
№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
		Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС
<b>1. Реальные инвестиции</b>									
	1. Тема 1. Инвестиционный проект. Стадии жизненного цикла. Бизнес-план Тема 2. Показатели экономической эффективности инвестиционного проекта	2							
	2. Тема 1. Инвестиционный проект. Стадии жизненного цикла. Бизнес-план Составление бизнес-плана Тема 2. Показатели экономической эффективности инвестиционного проекта Решение задач			2					
	3.							11	
<b>2. Оценка инвестиционных ценных бумаг</b>									
	1. Тема 3. Оценка акций Тема 4. Оценка облигаций	4							

2. Тема 3. Оценка акций Решение задач Тема 4. Оценка облигаций Решение задач			4					
3.							11	
<b>3. Оценка инструментов срочного рынка</b>								
1. Тема 5. Оценка фьючерсов. Арбитраж Тема 6. Оценка опционов. Биномиальная модель	4							
2. Тема 5. Оценка фьючерсов. Арбитраж Решение задач Тема 6. Оценка опционов. Биномиальная модель Решение задач			4					
3.							11	
<b>4. Модели формирования оптимального инвестиционного портфеля</b>								
1. Тема 7. Модель Марковитца Тема 8. Индексная модель. Модель арбитражного ценообразования	4							
2. Тема 7. Модель Марковитца Выполнение контрольного задания Тема 8. Индексная модель. Модель арбитражного ценообразования Выполнение контрольного задания			4					
3.							11	
Всего	14		14				44	

## **4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

### **4.1 Печатные и электронные издания:**

1. Шарп У.Ф., Александер Г. Д. Инвестиции: Учебник(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
2. Бочаров В.В. Инвестиции: Инвестиционный портфель. Источники финансирования. Выбор стратегии(Санкт-Петербург: Питер).
3. Боди З., Кейн А., Маркус А. Д. Принципы инвестиций: научно-популярная литература(М. ; СПб. ; Киев: Вильямс).
4. Андрианов А. Ю., Валдайцев С. В., Воробьев П. В., Воронова Н. С., Горбушина С. Г., Ковалев В. В., Иванов В. В., Лялин В. А. Инвестиции: электронный учебник(М.: Проспект).
5. Зиненко А. В. Инвестиционный анализ: учебно-методическое пособие (Красноярск: СФУ).

### **4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):**

1. Microsoft Windows (7, 8 или 10 версия)
2. Пакет приложений Microsoft Office Professional Plus 2010.

### **4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:**

1. Каждый обучающийся в течение всего периода обучения по дисциплине обеспечен индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечным системам (электронным библиотекам) и к электронной информационно-образовательной среде Университета (Электронно-библиотечная система СФУ. – Режим доступа: <http://bik.sfu-kras.ru/>).
2. Электронно-библиотечная система (электронная библиотека) и электронная информационно-образовательная среда обеспечивают возможность доступа обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет, и отвечают техническим требованиям организации, как на территории Университета, так и вне ее. Электронная информационно-образовательная среда Университета обеспечивает:
3. - доступ к учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), практик, и к изданиям электронных библиотечных систем и электронным образовательным ресурсам, указанным в рабочих программах;
4. - фиксацию хода образовательного процесса, результатов промежуточной аттестации и результатов освоения основной образовательной программы;
5. - проведение всех видов занятий, процедур оценки результатов обучения, реализация которых предусмотрена с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий;

6. - формирование электронного портфолио обучающегося, в том числе сохранение работ обучающегося, рецензий и оценок на эти работы со стороны любых участников образовательного процесса;
7. - взаимодействие между участниками образовательного процесса, в том числе синхронное и (или) асинхронное взаимодействие посредством сети Интернет.

### **5 Фонд оценочных средств**

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

### **6 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)**

Методика проведения занятий допускает как использование технических средств (проекторы, интерактивные доски), так и проведение занятий в классических аудиториях, обеспечиваемых стандартными материально-техническими средствами.

При использовании технических средств для проведения лекционных занятий необходим мультимедийный комплекс для учебных аудиторий, включающий интерактивную проекционную систему, компьютер для преподавателя с выходом в Интернет, интерактивный сенсорный дисплей, систему звукового сопровождения отображаемых материалов или доска для письма с маркерами.

Аудитория для проведения практических занятий должна быть оснащена компьютерами с выходом в Интернет или в аудитории должна быть возможность выхода в Интернет (при использовании личного ПК), доской для письма маркерами.

Для выполнения самостоятельной работы каждый студент должен иметь доступ к электронной информационно-образовательной среде организации с удаленного рабочего места (личный ПК, планшет, ПК в читальном зале библиотеки).