

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

Б1.В.ДВ.02.01 Инвестиционный анализ

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.05.01 Экономическая безопасность

Направленность (профиль)

38.05.01.31 Экономическая безопасность и финансовый мониторинг  
национальных, региональных и корпоративных социально-  
экономических систем

Форма обучения

заочная

Год набора

2022

Красноярск 2023

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили \_\_\_\_\_

канд. техн. наук, Доцент, Зиненко А.В.

\_\_\_\_\_  
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: Способен на основе обоснованного выбора методик и действующей нормативно-правовой базы проводить количественную и качественную оценку рисков для принятия управленческих решений, построения организационно-управленческих моделей и интегрированных систем управления рисками в организациях, в том числе по линии ПОД/ФТ</b>	
ПК-1.2: Применяет на практике методы, техники, технологии, программные средства и информационные базы идентификации и анализа изменения различных видов риска в динамике на основе использования бухгалтерской, налоговой, бюджетной и статистической отчетности	о программных средствах, предназначенных для инвестиционных расчетов, а также об информационных источниках о финансовых рынках решать статистические и оптимизационные задачи в финансах с использованием программных средств навыки владения на базовом уровне программными средствами статистического анализа финансовых рынков

### 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)	Семестр					
		1	2	3	4	5	6

### 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.							20	
<b>2. Оценка инвестиционных ценных бумаг</b>									
	1. Тема 3. Оценка акций Тема 4. Оценка облигаций	3							

2. Тема 3. Оценка акций Решение задач Тема 4. Оценка облигаций Решение задач			3					
3.							21	
<b>3. Оценка инструментов срочного рынка</b>								
1. Тема 5. Оценка фьючерсов. Арбитраж Тема 6. Оценка опционов. Биномиальная модель	2							
2. Тема 5. Оценка фьючерсов. Арбитраж Решение задач Тема 6. Оценка опционов. Биномиальная модель Решение задач			3					
3.							20	
<b>4. Модели формирования оптимального инвестицион-</b>								
1. Тема 7. Модель Марковитца Тема 8. Индексная модель Тема 9. Модель арбитражного ценообразования Тема 10. Модель CAPM	3							
2. Тема 7. Модель Марковитца Выполнение контрольного задания Тема 8. Индексная модель Выполнение контрольного задания Тема 9. Модель арбитражного ценообразования Решение задач Тема 10. Модель CAPM Решение задач			4					
3.							21	
Всего	10		12				82	

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

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

1. Лукасевич И.Я. Инвестиции: Учебник(Москва: Вузовский учебник).
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. 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.
- 3.

### **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).