

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

Б1.В.06 Финансовые инвестиции и риск менеджмент

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.04.01 Экономика

Направленность (профиль)

38.04.01.17 Финансово-экономическая аналитика и принятие решений в  
цифровой среде

Форма обучения

очная

Год набора

2023

Красноярск 2023

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили \_\_\_\_\_

канд.экон.наук, Доцент, Черкасова Юлия Ивановна

должность, инициалы, фамилия

## 1 Цели и задачи изучения дисциплины

### 1.1 Цель преподавания дисциплины

предоставление магистрантам возможности углубить знания принципов и методов формирования и обоснования экономически эффективных проектных инвестиционных решений при формировании портфеля долгосрочных активов на базе цифровых финансовых технологий в условиях неопределенности и рисков

### 1.2 Задачи изучения дисциплины

комплексное исследование современных теоретических, практических и организационных вопросов формирования и обоснования экономически эффективных проектных инвестиционных решений при формировании портфеля долгосрочных активов на базе цифровых финансовых технологий в условиях неопределенности и рисков

уточнение методов раскрытия причин и выбора актуальных проблем формировании портфеля долгосрочных активов на базе цифровых финансовых технологий в условиях неопределенности и рисков

расширение навыков обоснования экономически эффективных проектных инвестиционных решений при формировании портфеля долгосрочных активов на базе цифровых финансовых технологий в условиях неопределенности и рисков, проведения системного анализа тенденций для принятия стратегических финансовых решений в цифровой среде

### 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-3: Способен формировать и обосновывать экономически эффективные проектные решения на базе современных финансово-аналитических технологий с учетом факторов неопределенности и риска</b>	
ПК-3.1: Разрабатывает эффективные проектные решения с учетом неопределенности и риска	Умеет реферировать академические тексты, а также аннотировать различные академические тексты в с учетом языковой сферы их функционирования
ПК-3.2: Проводит доказательную оценку эффективности проектных решений с учетом неопределенности и риска	Знает факторы внутренней стоимости инвестиционных вложений, модели и инструменты расчета транзакционных и агентских издержек в зависимости от финансовых решений и потенциальных рисков Умеет разработать мероприятия по управлению рисками в рамках выбранных стратегий и оценивать эффективность разрабатываемых мероприятий с учетом затрат на их реализацию, влияния на основные параметры проекта и возможности возникновения вторичных рисков
<b>ПК-4: Способен готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в</b>	

<b>области финансово-экономической деятельности и принятия стратегических решений в цифровой среде</b>	
ПК-4.4: Анализирует источники информации и проводит необходимые экономические расчеты и выводы на их основе	Знает инструментарий анализа данных для проведения сценарного анализа изменения стоимости инвестиционного портфеля на основе изменения предпочтений инвесторов Знает современные международные и российские финансово-аналитические базы данных и программные средства, в том числе базы Томсон-Рейтер, Блумберг, Спарк, Интерфакс, Прайм и другие Умеет критически анализировать, интерпретировать информацию с учетом проводимых экономических расчетов, изменения предпочтений инвесторов, делает выводы об изменении целевого инвестиционного портфеля
<b>УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий</b>	
УК-1.1: Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними	Умеет осуществлять анализ проблемной ситуации (выявить ее составляющие, их функции, связи между ними и т.д.), используя конкретный системный подход Умеет формулировать суждения, основываясь на «внутренних» (внутренняя непротиворечивость, логика, достоверность и т.д.) и «внешних» (польза, реалистичность, непротиворечивость, применимость и т.д.) критериях
УК-1.3: Разрабатывает стратегию достижения поставленной цели как последовательность шагов, предвидя результат каждого из них и оценивая их влияние на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности	Умеет увидеть значимые факторы в процессе достижения цели, формулирует проблемные вопросы и определяет способы их решения Умеет расставить приоритеты между индикаторами (показателями) достижения цели, исходя из имеющихся ресурсов и ограничений Умеет представить стратегию как алгоритм осуществления деятельности (т.е. в виде последовательности шагов), проектируя ожидаемый результат каждого его шага ; Умеет оценить влияние принимаемого решения на внешнее окружение планируемой деятельности и на взаимоотношения участников этой деятельности
<b>УК-4: Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия</b>	
УК-4.1: Демонстрирует интегративные умения, необходимые для реферирования и аннотирования различных академических текстов (эссе, обзоров, статей и т.д.)	Знает академические и профессиональные термины в объеме достаточном для работы с аутентичными академическими текстами и текстами профессионального характера Умеет реферировать академические тексты, а также аннотировать различные академические тексты в с учетом языковой сферы их функционирования

#### **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=27289>.

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. час)	е
		1
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>1 (36)</b>	
занятия лекционного типа	0,33 (12)	
практические занятия	0,67 (24)	
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2 (72)</b>	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

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

№ п/п		Модули, темы (разделы) дисциплины		Контактная работа, ак. час.							
				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. Инвестиционная портфельная теория</b>											
		1. Финансовые активы в современной портфельной теории		2							
		2. Финансовые активы в современной портфельной теории				4					
		3. Подходы к количественной оценке неопределенности		2							
		4. Подходы к количественной оценке неопределенности				4					
		5. Риск и доходность финансовых активов: инструментарий оценки для портфеля		2							
		6. Риск и доходность финансовых активов: инструментарий оценки для портфеля				4					
		7.								36	
<b>2. Разработка инвестиционного портфеля</b>											
		1. Разработка инвестиционного портфеля финансовых активов для инвестора		2							

2. Разработка инвестиционного портфеля финансовых активов для инвестора			4					
3. Управление целевым инвестиционным портфелем	2							
4. Управление целевым инвестиционным портфелем.			4					
5. Современные тенденции в управлении инвестиционным портфелем	2							
6. Современные тенденции в управлении инвестиционным портфелем			4					
7.							36	36
Всего	12		24				72	72



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

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

1. Галанов В. А. Производные финансовые инструменты: Учебник (Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
2. Чижик В.П. Финансовые рынки и институты: Учебное пособие(Москва: Издательство "ФОРУМ").
3. Шнюкова Е. А. Финансовый анализ и финансовое моделирование: учебное пособие(Красноярск: СФУ).
4. Ферова И. С., Кузьмина И. Г., Улина С. Л. Корпоративные финансы: учебник для укрупненной группы направлений "Экономика и управление"(Москва: КноРус).
5. Серов В. М., Богомолова Е.А. Инвестиционный анализ: Учебник (Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
6. Макарова С. Н., Ферова И. С., Янкина И. А. Управление финансовыми рисками: монография(Красноярск: СФУ).
7. Барлаков С. А., Свиридова Т. А. Инвестиционный менеджмент: Учебное пособие(Санкт-Петербург: Интермедия).
8. Каячева Л. В. Страхование инвестиционных рисков. Лекции: учебно-методическое пособие [для магистрантов, обучающихся по программе 38.04.02.05 «Проектный менеджмент»](Красноярск: СФУ).
9. Шнюкова Е.А. Инвестиционный анализ: [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.04.02.13 Финансовый менеджмент] (Красноярск: СФУ).
10. Шнюкова Е.А. Инвестиционный анализ и управление инвестициями: [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.05.01.06 Финансово-экономическое обеспечение федеральных государственных органов, обеспечивающих безопасность Российской Федерации] (Красноярск: СФУ).
11. Шнюкова Е.А. Финансовый менеджмент: [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.03.01.03.07 Финансы и кредит: государственные и муниципальные финансы](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. Операционные системы Microsoft Windows XP SP3, Microsoft Windows, Server 2003 sp2
2. Офисный пакет Microsoft Office 2003 SP3, Microsoft Office FrontPage 2003, Microsoft Office Visio 2003, Microsoft Office PROJECT 2003, Open Office 3.0.1
3. Браузер Mozilla FireFox
4. Архиватор 7-ZIP
5. Антивирус ESET NOD32

6. Обучающие программные продукты Консультант +
7. Project Expert 6
8. Audit Expert 3

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

1. POLPRED.COM Обзор СМИ <http://www.polpred.com> Антиплагиат. ВУЗ <http://sfukras.antiplagiat.ru> Государственный архив Красноярского края (ГАКК): <http://красноярские-архивы.рф> Научная электронная библиотека (eLIBRARY.RU): <http://elibrary.ru> Университетская информационная система РОССИЯ (УИС РОССИЯ): <http://uisrussia.msu.ru> Электронная библиотека издательского дома «Гребенников»: <http://grebennikon.ru> Электронная библиотека диссертаций РГБ: <http://dvs.rsl.ru> (доступ к полному тексту), <http://diss.rsl.ru> (доступ к каталогу) Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ» <http://www.biblio-online.ru> Электронно-библиотечная система «ИНФРА-М»: <http://www.znaniium.com> Электронно-библиотечная система «Национальный цифровой ресурс «Рукопт»: <http://rucont.ru> Электронно-библиотечная система «Лань»: <http://e.lanbook.com> Электронно-библиотечная система «BOOK.ru»: <http://www.book.ru> Электронно-библиотечная система «ibooks.ru»: <http://ibooks.ru> ;
2. Cambridge University Press: <http://www.journals.cambridge.org> , Elsevier: <http://www.sciencedirect.com> , Euromonitor International: <http://www.portal.euromonitor.com> , Henry Stewart Talks: [www.hstalks.com](http://www.hstalks.com) , IEEE/IEL Database <http://ieeexplore.ieee.org> , Oxford Journals: <http://www.oxfordjournals.org>, Oxford Russia Fund eContent library: <http://lib.myilibrary.com> , ProQuest: <http://search.proquest.com/> , SciVal: <https://www.scival.com/> , Scopus: <http://www.scopus.com> , Springer:<http://www.springerlink.com> , Taylor&Francis:<http://www.tandfonline.com>, Web of Science: <http://isiknowledge.com> , WILEY: <http://wileyonlinelibrary.com> .

#### **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)**

- лекционные аудитории (оборудованные современным видеопроjectionным оборудованием для презентаций, средствами звуковоспроизведения, экраном, и имеющие выход в Интернет); 6 лекционных аудиторных комплексов снабженных: Мультимедийный проектор Epson EMP-X5, пульт дистанционного управления, Сдвоенная радиосистема Audio-Technica ATW-702/701P Консоль управления #1 HP TFT7600 RKM в составе LCD монитор и клавиатура, Инсталляционный усилитель мощности Electro-Voice PA2250T, Акустическая система для фонового озвучивания Electro-Voice EVID 4.2T. Колонка, Компьютер Kraftway Credo модель KC35 - в/контр. Intel GRAPHICS Media Accelerator 950. до224Мб с\контроль. 10/100/100); 4 компьютерных класса с компьютерами Kraftway, с досками прямой проекции, проектор EPSON EMP-X5;
- 6 мобильных тележек (класс AquaCartMC116, специальное ПО для коллективной работы, WindowsXP, тележка сейф, проект);
- помещения для проведения семинарских и практических занятий (оборудованные мультимедийным оборудованием и учебной мебелью-трансформ); 6 кабинетов с программно-аппаратным комплексом с ПО SANACO LAB 300 на16 мест; проектором PANASONIC PT-F200NT; интерактивной доской Interwrite; интерактивной плазменной панелью Smartboard;
- 3 семинарских аудитории с досками обратной проекции SMARTBoard.
- для занятий по иностранному языку 6 лингафонных кабинетов с лингафонным и программно-аппаратным комплексом с ПО SANACO LAB 300 на16 мест; проектором PANASONIC PT-F200NT; интерактивной доской Interwrite; интерактивной плазменной панелью Smartboard