

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Волхонов Михаил Станиславович

Должность: Врио ректора

Дата подписания: 24.09.2023 22:19:42

Уникальный программный ключ:

b2dc75470204bc2bfec58d577a1b983ee223ea27559d45aab6272df0610c6e81

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

«КОСТРОМСКАЯ ГОСУДАРСТВЕННАЯ СЕЛЬСКОХОЗЯЙСТВЕННАЯ АКАДЕМИЯ»

Согласовано:

Председатель методической комиссии
экономического факультета

_____ / Королева Е.В./

«07» июня 2023 года

Утверждаю:

Декан экономического факультета

_____ / Середа Н.А./

«14» июня 2023 года

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

ИНВЕСТИЦИИ

Направление подготовки

/специальность/

38.04.01 Экономика

Направленность (профиль)

Корпоративные финансы

Квалификация выпускника

магистр

Форма обучения

очно-заочная

Срок освоения ОПОП ВО

2 года 4 месяца

Караваево 2023

1. Цель и задачи дисциплины

Цель дисциплины:

формирование теоретических знаний и практических умений по разработке инвестиционных проектов, оценке их экономической, социальной и бюджетной эффективности, выявлению инвестиционных рисков и разработки мероприятий по их снижению, формированию и оптимизации инвестиционного портфеля, навыков инвестирования в финансовые активы.

Задачи дисциплины:

- изучение теоретических основ организации и функционирования инвестиций, финансово-инвестиционной деятельности и процессе принятия инвестиционных решений;
- рассмотреть нормативно-правовое регулирование и организационное обеспечение инвестиционной деятельности;
- изучение методических подходов оценки эффективности инвестиционных проектов;
- формирование практических умений и навыков выявления и оценки инвестиционных рисков;
- изучение методов и развитие практических умений и навыков оптимизации инвестиционного портфеля предприятия.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

2.1 Дисциплина Б1.В.04 «Инвестиции» относится к части Блока 1 «Дисциплины (модули) ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

2.2. Для изучения данной дисциплины (модуля) необходимы знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами:

- Управленческая экономика
- Финансовое моделирование бизнес-процессов

2.3. Перечень последующих дисциплин, для которых необходимы знания, умения и навыки, формируемые данной дисциплиной:

- Риск-менеджмент
- Итоговая аттестация

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование и развитие компетенций:
УК-2; ПКос-1; ПКос-2

Категория компетенции	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
Универсальные компетенции	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	ИД-1 _{УК-2} Разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы: формулирует цель, задачи, обосновывает актуальность, значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы их применения; ИД-2 _{УК-2} Разрабатывает план реализации проекта с учетом вероятных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы ИД-3 _{УК-2} Осуществляет мониторинг хода реализации проекта, корректирует

		отклонения, вносит дополнительные изменения в план реализации проекта, уточняет зоны ответственности участников проекта. ИД-4 _{ук-2} Предлагает процедуры и механизмы оценки качества проекта, инфраструктурные условия для внедрения результатов проекта
Профессиональные компетенции	ПКос-1 Способен проводить финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	ИД-1 _{ПКос-1} Формирует и анализирует информацию о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам ИД-2 _{ПКос-1} Понимает и разъясняет суть, юридические и экономические характеристики финансовых продуктов и услуг
	ПКос-2 Способен разрабатывать финансовый план и целевой инвестиционный портфель	ИД-1 _{ПКос-2} Осуществляет финансовый анализ и финансовое планирование, мониторинг выполнения финансового плана ИД-2 _{ПКос-2} Моделирует параметры целевого инвестиционного портфеля, разрабатывает рекомендации по управлению инвестициями

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать:

Нормативные правовые документы в области инвестирования

Экономические и юридические аспекты инвестиционной деятельности

Методы расчета стоимости инвестиционных решений и инвестиционных рисков

Порядок составления и заключения договоров об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий

Принципы портфельного управления инвестированием

Методы количественного и качественного анализа состава, эффективности и рисков инвестиционного портфеля

Методики инвестиционного профилирования организаций

Уметь:

Собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра инвестиционных услуг

Выступать в качестве эксперта в процессе принятия организацией важных инвестиционных решений

Рассчитывать стоимость инвестиционных решений и инвестиционных рисков

Планировать, прогнозировать и оценивать изменения финансовой ситуации при пользовании инвестиционными услугами

Проверять достоверность информации об инвестиционной услуге с экономической и юридической точек зрения

Отстаивать интересы организации в повышении качества, доступности и безопасности инвестиционных услуг

Рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей

Рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала

Рассчитывать величину инвестиционного портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей

Проводить структурированное интервью и анкетирование клиента на предмет инвестиционного профиля

Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля

Владеть:

Навыками консультирования по вопросам управления кредитным инвестиционным портфелем

Навыками составления инвестиционного портфеля

Навыками проведения расчетов величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей, расчета размера инвестиций, необходимого для достижения целей клиента, расчета целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала, расчета параметров целевого инвестиционного портфеля

Навыками составления перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском, проведению сценарного анализа, согласования условий инвестиционного портфеля с клиентом, пересмотра качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов)

Навыками установления критериев оценки показателей инвестиционного портфеля, формирования финансового плана и критериев мониторинга его выполнения

Навыками мониторинга финансового плана, определения критериев эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля, осуществления анализа изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля, составления прогноза денежного потока, моделирования целевого инвестиционного портфеля

4. Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

Форма промежуточной аттестации – экзамен.

Вид учебной работы	Всего часов, 3 семестр
Контактная работа (всего)	36,5
В том числе:	
Лекции (Л)	10
Практические занятия (ПЗ), Семинары (С)	26
Консультации (К)	0,5
Самостоятельная работа студента (СРС) (всего)	107,5
В том числе:	

Подготовка к практическим занятиям		26
Самостоятельное изучение учебного материала		35,5
Расчетно-аналитическая работа		10
Вид промежуточной аттестации	зачет (З)	
	экзамен (Э)	36*
Общая трудоемкость / контактная работа	часов	144/36,5
	зач. ед.	4/1,0

* - часы используются для подготовки к контрольным испытаниям в течение семестра

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины, виды учебной деятельности и формы контроля

№ п/п	№ семестра	Наименование раздела (темы) дисциплины (модуля)	Вид учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов (в часах)					Форма текущего контроля успеваемости
			Л	Пр/С/Лаб	К, КР (КП)	СР	всего	
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1.	3	1. Инвестиции, инвестиционная деятельность и государственное регулирование инвестиционной деятельности	2	2		12	16	Тестирование
2.	3	2. Инвестиционный проект и оценка его эффективности	2	8		30	40	Контрольная работа Тестирование
3.	3	3. Инвестиционный риск	2	6		28	36	Тестирование
4.	3	4. Финансовые инвестиции	2	4		16	22	Контрольная работа Тестирование
5.	3	5. Формирование и управление инвестиционным портфелем	2	6		21,5	29,5	Контрольная работа Тестирование
6.	3	Консультации			0,5		0,5	
		ИТОГО:	10	26	0,5	107,5	144	

5.2. Практические и семинарские занятия, лабораторные работы

№ п/п	№ семестра	Наименование раздела (темы) дисциплины (модуля)	Наименование лабораторных (практических, семинарских) работ	Всего часов
1	2	3	4	
1.	3	1. Инвестиции, инвестиционная деятельность и государственное регулирование инвестиционной	1. Изучение деятельности финансовых институтов на инвестиционном рынке 2. Изучение методов регулирования инвестиционной деятельности на федеральном и региональном уровне.	2

		деятельности		
2.	3	2. Инвестиционный проект и оценка его эффективности	1. Оценка финансовой состоятельности проекта. 2. Оценка экономической эффективности проекта 3. Оценка бюджетной эффективности проекта	8
3.	3	3. Инвестиционный риск	1 Анализ чувствительности 2. Анализ безубыточности 3. Анализ сценариев	6
4.	3	4. Финансовые инвестиции	1. Оценка инвестиционных характеристик акций. 2. Оценка инвестиционных характеристик облигаций.	4
5.	3	5. Формирование и управление инвестиционным портфелем	1. Оценка доходности инвестиционного портфеля 2. Оценка риска инвестиционного портфеля 3. Оптимизация инвестиционного портфеля	6
		ИТОГО:		26

5.3. Примерная тематика курсовых работ

Курсовая работа не предусмотрена

5.4. Самостоятельная работа студента

№ п/п	№ семестра	Наименование раздела учебной дисциплины (модуля)	Виды СРС	Всего часов
1	2	3	4	5
1.	3	1. Инвестиции, инвестиционная деятельность и государственное регулирование инвестиционной деятельности	Самостоятельное изучение материала Подготовка к контрольным испытаниям.	12
2.	3	2. Инвестиционный проект и оценка его эффективности	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Выполнение расчетно-аналитической работы. Подготовка к контрольным испытаниям.	30
3.	3	3. Инвестиционный риск	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Выполнение расчетно-аналитической работы. Подготовка к контрольным	28

			испытаниям.	
4.	3	4. Финансовые инвестиции	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Самостоятельное изучение материала Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	16
5.	3	5. Формирование и управление инвестиционным портфелем	Подготовка к лекциям и практическим занятиям. Выполнение домашних заданий. Подготовка к контрольным испытаниям.	21,5
ИТОГО часов в семестре:				107,5

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания учебной и учебно-методической литературы	Количество экземпляров
1	Алиев, А.Т. Управление инвестиционным портфелем [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности "Финансы и кредит" / А. Т. Алиев, К. В. Сомик. - Электрон. дан. - Москва : Дашков и К°, 2017. - 160 с. : ил. - (Издательско-торговая корпорация "Дашков и К°"). - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/93423/ , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-01292-1.	Неограниченный доступ
2	Инвестиции и инновации [Электронный ресурс] : учебник / Щербаков В.Н., ред. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К°, 2017. - 658 с. - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/91224/ , требуется регистрация. - Загл. с экрана. - Яз. рус. - ISBN 978-5-394-02781-9.	Неограниченный доступ
3	Алексеев, В.Н. Формирование инвестиционного проекта и оценка его эффективности [Электронный ресурс] : учебно-практическое пособие / В. Н. Алексеев, Н. Н. Шарков. - Электрон. дан. - Москва : Дашков и К°, 2017. - 176 с. - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/94033/#2 , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-02815-1.	Неограниченный доступ
4	Шапкин, А.С. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг [Электронный ресурс] / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 4-е изд., пересмотр. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К°, 2018. - 343 с. - Режим доступа: https://e.lanbook.com/reader/book/103781/#2 , требуется регистрация. - Яз. рус. - Загл. с экрана. - ISBN 978-5-394-02999-8.	Неограниченный доступ
5	Инвестиционное проектирование: основы теории и практики :	Неограниченный

	учебное пособие / А. П. Москаленко, С. А. Москаленко, Р. В. Ревунов, Н. И. Вильдяева. — Санкт-Петербург : Лань, 2018. — 376 с. — ISBN 978-5-8114-2827-4. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: https://e.lanbook.com/book/106728 . — Режим доступа: для авториз. пользователей.	доступ
6	Инвестиции : практикум для контактной и самостоятельной работы студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Корпоративные финансы» очно-заочной формы обучения / Королева Е. В., сост. ; Костромская ГСХА. Кафедра финансов и кредита. - Караваево : Костромская ГСХА, 2021. - 56 с. - URL: http://lib.ksaa.edu.ru/marcweb/books/metod/M21_3579.pdf . - M121.1.	Неограниченный доступ

6.2. Лицензионное программное обеспечение

6. Наименование программного обеспечения	Сведения о правообладателе (лицензиат, номер лицензии, дата выдачи, срок действия)и заключенном с ним договоре
Windows Prof 7 Academic Open License	Майкрософт, 47105956, 30.06.2010, постоянная
Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License	Майкрософт, 47105956, 30.06.2010, постоянная
Microsoft Windows SL 8.1 Russian Academic Open License	Майкрософт, 64407027, 25.11.2014, постоянная
Microsoft Office 2013 Russian Academic Open License	Майкрософт, 64407027, 25.11.2014, постоянная
Microsoft Exchange Standard 2007 Academic Device CAL	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Academic Device CALЭ	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft SQL Server Standard Edition Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Exchange Server Standard Edition Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Terminal Svcs Device CAL	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2008 Academic	Майкрософт, 44794865, 13.11.2008, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2008 R2 Academic	Майкрософт, 48946846, 24.08.2011, постоянная
Microsoft Forefront TMG Standard 2010	Майкрософт, 48946846, 24.08.2011, постоянная
Microsoft Windows Server Standard 2012 Academic	Майкрософт, 61149292, 15.11.2012, постоянная
Sun Rav Book Office	Sun Rav Software, 25.04.2012, постоянная
Sun Rav Test Office Pro	Sun Rav Software, 25.04.2012, постоянная
Программное обеспечение «Антиплагиат»	АО «Антиплагиат», лицензионный договор № 5442 от 05.09.2022, 1 год
Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Стандартный Russian Edition. 250-499Node 1 year Educational Renewal License	ООО «ДримСофт», договор №126 от 30.03.2023, 1 год

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование специальных* помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения. Реквизиты подтверждающего документа
Учебные аудитории	Аудитория 267,	Microsoft Windows SL 8.1 Russian

<p>для проведения занятий лекционного типа</p>	<p>оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения: 1 компьютер с доступом в электронно-образовательную среду Академии, ЭБС и сети Интернет: Intel(R) Pentium(R) CPU G3260 @ 3.30GHz, проектор Учебная мебель: стол преподавателя, столы ученические - 19 шт., 39 стульев</p>	<p>Academic Open License 64407027, Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License 47105980, Kaspersky Endpoint Security Standart Edition Educational</p>
<p>Учебные аудитории для проведения лабораторно-практических занятий и занятий семинарского типа</p>	<p>Аудитория 357, оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения: 11 компьютеров с доступом в электронно-образовательную среду Академии, ЭБС и сети Интернет: Intel(R) Core(TM) i3-4150 CPU @ 3.50GHz Учебная мебель: стол преподавателя, столы ученические – 9 шт., 18 стульев.</p>	<p>Microsoft Windows 7 (Windows Prof 7 Academic Open License Майкрософт 47105956 30.06.2010). Google Chrome (нелицензируется). Microsoft Office 2007 (Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License Майкрософт 47105956 30.06.2010. CoreDRAW Graphics Suite 2020. Mathcad 15</p>
<p>Учебные аудитории для курсового проектирования (выполнения курсовых работ) и самостоятельной работы</p>	<p>Аудитория 257, оснащенная специализированной мебелью и техническими средствами обучения Компьютеры – 16 шт. с доступом в электронно-образовательную среду Академии, ЭБС и сети Интернет Intel(R) Pentium(R) CPU G4600 @ 3.60GHz:.</p>	<p>Microsoft Windows 7 (Windows Prof 7 Academic Open License Майкрософт 47105956 30.06.2010) Kaspersky Endpoint Security для Windows Google Chrome (не лицензируется) Microsoft Office 2007 (Microsoft Office 2010 Russian Academic Open License Майкрософт 47105956 30.06.2010 Mathcad 14 Autodesk AutoCAD 2015 (Autodesk Education Master Suite 2020 Autodesk 555-70284370 21.10.2020) CoreDRAW Graphics Suite X6</p>

		АИБС МАРК-SQL 1.17 КОМПАС-3D V15.2 (КОМПАС- Автопроект КОМПАС 3D V14 АСКОН МЦ-14-00430 01.01.2010 постоянная)
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Аудитория 255, оснащенная специализированной мебелью: столы ученические 9 шт., стол преподавателя 1 шт., стулья 19 шт., стенд обучающий 1 шт., витраж с тумбами 1 шт., доска ученическая 1 шт., шкаф для документов 1 шт., трибуна 1 шт., стол лабораторный 1 шт., демонстрационный материал.	
Помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования	Аудитория 440 Сервер RStyle , Сервер DEPO, Сервер IntelP4308, Компьютер i5/8G/1TB Компьютер i5/8/500G Компьютер i5/8/500G Компьютер E6850/4/500G Компьютер i5/4/500G	Microsoft Windows Server Standard 2008 Academic Lic 44794865 Microsoft Windows Server Standard 2008 R2 Academic Lic 48946846 Microsoft SQL Server Standard Edition Academic Lic 44794865 Windows 7, Office 2007, Microsoft Open License 64407027,47105956
	Аудитория 117 Компьютер i7/4/500 Компьютер Celeron 2.8/512/360 Паяльная станция, осциллограф, мультиметр, микроскоп	Windows 7, Office 2007, MicrosoftOpenLicense 64407027,47105956

*Специальные помещения – аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика направленности (профиля) «Корпоративные финансы»

Составитель (и):

Доцент кафедры «Финансы и кредит»

Королева Е.В.

Заведующий кафедрой «Финансы и кредит»

Исина Н.Ю.