

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ
ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Забайкальский государственный университет»
(ФГБОУ ВО «ЗабГУ»)

Факультет экономики и управления
Кафедра Экономики и бухгалтерского учета

УТВЕРЖДАЮ:

Декан факультета

Факультет экономики и
управления

Лавров Александр Юрьевич

«___» _____ 20___
г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.03.01 Прогнозирование рисков инвестиционного проекта
на 144 часа(ов), 4 зачетных(ые) единиц(ы)
для направления подготовки (специальности) 38.04.08 - Финансы и кредит

составлена в соответствии с ФГОС ВО, утвержденным приказом
Министерства образования и науки Российской Федерации от
«___» _____ 20___ г. №___

Профиль – Финансы (для набора 2022)
Форма обучения: Очная

1. Организационно-методический раздел

1.1 Цели и задачи дисциплины (модуля)

Цель изучения дисциплины:

Формирование аналитического, оценочного мышления для инвестиционного планирования, прогнозирования, прогнозирования рисков инвестиционного проекта в целях инвестиционной политики для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Задачи изучения дисциплины:

- освоение подходов и методики оценки эффективности инвестиционных проектов;
- освоение подходов и методики оценки, управления и прогнозирования рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов; использования теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса;
- освоение подходов, методологии и методик аналитической работы при анализе и оценке финансовых рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития;
- освоение подходов, методологии и методик аналитической работы при анализе и оценке влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности;
- освоение подходов, методологии и методик оценки инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций; выбора инвестиционных проектов и формирования портфеля проектов;
- освоение методики анализа влияния инвестиционной активности на изменения в бухгалтерском балансе и отчете о финансовых результатах в целях формирования инвестиционной политики и устойчивого финансового положения.

1.2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП

Цикл (раздел) Б1.В.ДВ.03.1 Блок 1 Дисциплины (модули), Дисциплины по выбору, магистерская программа «Финансы»

1.3. Объем дисциплины (модуля) с указанием трудоемкости всех видов учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 4 зачетных(ые) единиц(ы), 144 часов.

Виды занятий	Семестр 3	Всего часов
Общая трудоемкость		144
Аудиторные занятия, в т.ч.	34	34
Лекционные (ЛК)	17	17

Практические (семинарские) (ПЗ, СЗ)	17	17
Лабораторные (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа студентов (СРС)	110	110
Форма промежуточной аттестации в семестре	Зачет	0
Курсовая работа (курсовой проект) (КР, КП)		

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы		Планируемые результаты обучения по дисциплине
Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции, формируемые в рамках дисциплины	Дескрипторы: знания, умения, навыки и (или) опыт деятельности
УК-3	<p>УК-3.1. Знать основные правила и условия для организации эффективной командной работы; базовые принципы, определяющие план действий для достижения поставленной цели.</p> <p>УК-3.2. Уметь осуществлять руководство членами команды, распределяя и делегируя полномочия между ними для достижения наиболее быстрого и лучшего результата.</p> <p>УК-3.3. Владеть навыками грамотной и эффективной организации, координации и руководства командным взаимодействием при решении профессиональных задач для достижения поставленной цели</p>	<p>Знать: Знать основные правила и условия для организации эффективной командной работы; базовые принципы, определяющие план действий для достижения поставленной цели по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной</p>

привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Уметь: Уметь осуществлять руководство членами команды, распределяя и делегируя полномочия между ними для достижения наиболее быстрого и лучшего результата по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и

формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Владеть: Владеть навыками грамотной и эффективной организации, координации и руководства командным взаимодействием при решении профессиональных задач для достижения поставленной цели по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на

		<p>изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности</p>
<p>УК-6</p>	<p>УК-6.1. Знать основы, направления, источники и способы совершенствования профессиональной деятельности с учетом условий, средств, личностных возможностей, этапов карьерного роста и требований рынка труда.</p> <p>УК-6.2. Уметь правильно формулировать цели, задачи и планировать время для профессионального развития и карьерного роста с учетом условий, средств, личностных возможностей, и требований рынка труда; оптимально использовать собственные ресурсы и возможности для успешной профессиональной деятельности; критически оценивать собственные ресурсы и возможности для успешной профессиональной деятельности.</p> <p>УК-6.3. Владеть навыками и приемами определения, планирования, реализации и совершенствования профессиональной деятельности с учетом условий, средств, личностных возможностей, этапов карьерного роста и требований рынка труда.</p>	<p>Знать: Знать основы, направления, источники и способы совершенствования профессиональной деятельности с учетом условий, средств, личностных возможностей, этапов карьерного роста и требований рынка труда по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисковых инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых</p>

результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Уметь: Уметь правильно формулировать цели, задачи и планировать время для профессионального развития и карьерного роста с учетом условий, средств, личностных возможностей, и требований рынка труда; оптимально использовать собственные ресурсы и возможности для успешной профессиональной деятельности; критически оценивать собственные ресурсы и возможности для успешной профессиональной деятельности по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и

формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Владеть: Владеть навыками и приемами определения, планирования, реализации и совершенствования профессиональной деятельности с учетом условий, средств, личностных возможностей, этапов карьерного роста и требований рынка труда в рамках тем по дисциплине: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов;

		<p>Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности</p>
<p>ПК-1</p>	<p>ПК-1.1. Знает алгоритм отбора методов аналитической работы с финансовой информацией. ПК-1.2. Умеет определять задачи аналитических исследований в области финансов с целью подбора оптимального метода анализа и прогноза финансовой устойчивости организаций различных организационно-правовых форм ПК-1.3. Владеет навыками выбора метода анализа финансовой информации и прогноза финансовой устойчивости организаций различных организационно-правовых форм</p>	<p>Знать: Знать алгоритм отбора методов аналитической работы с финансовой информацией по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное</p>

планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Уметь: Уметь определять задачи аналитических исследований в области финансов с целью подбора оптимального метода анализа и прогноза финансовой устойчивости организаций различных организационно-правовых форм по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков

инвестиционного проекта.
Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Владеть: Владеть навыками выбора метода анализа финансовой информации и прогноза финансовой устойчивости организаций различных организационно-правовых форм по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста

		деятельности
ПК-2	<p>ПК-2.1. Знает оптимальные приемы и методы отбора информации для проведения соответствующего анализа.</p> <p>ПК-2.2. Умеет проводить расчет и анализ финансовых показателей в соответствии с поставленными задачами.</p> <p>ПК-2.3. Владеет навыками оценки финансовых показателей и составления прогноза их динамики.</p>	<p>Знать: Знать оптимальные приемы и методы отбора информации для проведения соответствующего анализа по темам дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности</p> <p>Уметь: Уметь проводить расчет и анализ финансовых показателей в соответствии с поставленными задачами по темам дисциплины:</p>

Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности

Владеть: Владеть навыками оценки финансовых показателей и составления прогноза их динамики в рамках тем дисциплины: Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта; Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов.

		<p>Использование теории опционов для оценки рисков инвестиций и стоимости бизнеса; Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития; Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов; Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности; Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности</p>
--	--	--

3. Содержание дисциплины

3.1. Разделы дисциплины и виды занятий

3.1 Структура дисциплины для очной формы обучения

Модуль	Номер раздела	Наименование раздела	Темы раздела	Всего часов	Аудиторные занятия			С Р С
					Л К	П З (С З)	Л Р	
1	1.1	Оценка эффективности и инвестицион	1. Цели, задачи; классификация инвестиционных	21	0	1	0	20

		ных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта	проектов; методы оценки и системы показателей; тактические и стратегические задачи эффективности; критерии, условия 2. Методика анализа и оценки эффективности инвестиционных проектов, денежных потоков от инвестиционного проекта						
	1.2	Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	1.Цели, задачи; понятийный аппарат оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; методы оценки, управления и прогнозирования рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов; виды моделей; системы показателей 2.Методики оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; долгосрочных инвестиционных проектов. Методы и методики использования теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	22	1	1	0	20	
2	2.1	Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о	1.Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и системы показателей; методы оценки;	22	1	1	0	20	

		финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития	тактические и стратегические задачи; критерии, условия 2.Методика анализа и оценки рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития						
	2.2	Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов.	1.Цели, задачи; понятийный аппарат оценки инвестиционной привлекательности; методы оценки инвестиционной привлекательности, чувствительности проектов долгосрочных инвестиций, выбора проектов и методы формирования портфеля проектов; виды моделей; системы показателей. 2. Методики оценки инвестиционной привлекательности. Методики выбора инвестиционных проектов и формирования портфеля проектов.	23	2	1	0	20	
3	3.1	Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе,	1.Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и оценки; системы показателей;	28	2	2	0	24	

		отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности	тактические и стратегические задачи; критерии, условия 2.Методика анализа и оценки влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности					
	3.2	Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности	1.Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; модели и методы инвестиционной политики с учетом тактических и стратегических задач; критерии, условия. Модели и методы прогнозирования рисков инвестиционного проекта. 2.Основные этапы разработки инвестиционного плана, составление прогноза инвестиционной политики на основе результатов финансового анализа, оценки рисков, оценки финансовых и капитальных инвестиций для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности.	28	2	2	0	24
Итого				144	8	8	0	128

3.2. Содержание разделов дисциплины

3.2.1. Лекционные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)
1	1.2	Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	Цели, задачи; понятийный аппарат оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; методы оценки, управления и прогнозирования рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов; виды моделей; системы показателей. Методики оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; долгосрочных инвестиционных проектов. Методы и методики использования теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	1
2	2.1	Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития	Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и системы показателей; методы оценки; тактические и стратегические задачи; критерии, условия. Методика анализа и оценки рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития	1
	2.2	Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов	Цели, задачи; понятийный аппарат оценки инвестиционной привлекательности; методы оценки инвестиционной привлекательности, чувствительности проектов долгосрочных инвестиций, выбора	2

		долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов.	проектов и методы формирования портфеля проектов; виды моделей; системы показателей. Методики оценки инвестиционной привлекательности. Методики выбора инвестиционных проектов и формирования портфеля проектов.	
3	3.1	Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности	Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и оценки; системы показателей; тактические и стратегические задачи; критерии, условия. Методика анализа и оценки влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности	2
	3.2	Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности	Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; модели и методы инвестиционной политики с учетом тактических и стратегических задач; критерии, условия. Модели и методы прогнозирования рисков инвестиционного проекта. Основные этапы разработки инвестиционного плана, составление прогноза инвестиционной политики на основе результатов финансового анализа, оценки рисков, оценки финансовых и капитальных инвестиций для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности.	2

3.2.2. Практические занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)

1	1.1	<p>Оценка эффективности и инвестиционных проектов.</p> <p>Денежные потоки от инвестиционного проекта</p>	<p>Цели, задачи; классификация инвестиционных проектов; методы оценки и системы показателей; тактические и стратегические задачи эффективности; критерии, условия.</p> <p>Методика анализа и оценки эффективности инвестиционных проектов, денежных потоков от инвестиционного проекта: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	1
	1.2	<p>Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов.</p> <p>Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса</p>	<p>Цели, задачи; понятийный аппарат оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; методы оценки, управления и прогнозирования рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов; виды моделей; системы показателей Методики оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; долгосрочных инвестиционных проектов. Методы и методики использования теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	1
2	2.1	<p>Анализ и оценка рисков,</p>	<p>Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и</p>	1

		<p>кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития</p>	<p>зарубежной практике; методы анализа и системы показателей; методы оценки; тактические и стратегические задачи; критерии, условия. Методика анализа и оценки рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития: составление структурно-логических схем, классификационных схем; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	
	2.2	<p>Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов.</p>	<p>Цели, задачи; понятийный аппарат оценки инвестиционной привлекательности; методы оценки инвестиционной привлекательности, чувствительности проектов долгосрочных инвестиций, выбора проектов и методы формирования портфеля проектов; виды моделей; системы показателей. Методики выбора инвестиционных проектов и формирования портфеля проектов: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	1
3	3.1	<p>Анализ и оценка влияния рисков инвест</p>	<p>Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы</p>	2

		<p>иционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности</p>	<p>анализа и оценки; системы показателей; тактические и стратегические задачи; критерии, условия. Методика анализа и оценки влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	
3.2	<p>Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности</p>	<p>Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; модели и методы инвестиционной политики с учетом тактических и стратегических задач; критерии, условия. Модели и методы прогнозирования рисков инвестиционного проекта. Основные этапы разработки инвестиционного плана, составление прогноза инвестиционной политики на основе результатов финансового анализа, оценки рисков, оценки финансовых и капитальных инвестиций для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности: составление структурно-логических схем, классификационных схем; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах</p>	2	

выбранной компании)

3.2.3. Лабораторные занятия, содержание и объем в часах

Модуль	Номер раздела	Тема	Содержание	Трудоемкость (в часах)

3.3. Содержание материалов, выносимых на самостоятельное изучение

Модуль	Номер раздела	Содержание материалов, выносимого на самостоятельное изучение	Виды самостоятельной деятельности	Трудоемкость (в часах)
1	1.1	Оценка эффективности инвестиционных проектов. Денежные потоки от инвестиционного проекта	Цели, задачи; классификация инвестиционных проектов; методы оценки и системы показателей; тактические и стратегические задачи эффективности; критерии, условия. Методика анализа и оценки эффективности инвестиционных проектов, денежных потоков от инвестиционного проекта: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)	20

	1.2	Оценка, управление и прогнозирование рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов. Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	Цели, задачи; понятийный аппарат оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; методы оценки, управления и прогнозирования рисками проектов, долгосрочных инвестиционных проектов; виды моделей; системы показателей. Методики оценки, управления и прогнозирования рисками проектов; долгосрочных инвестиционных проектов. Методы и методики использования теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)	20
2	2.1	Анализ и оценка рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели	Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и системы показателей; методы оценки; тактические и стратегические задачи;	20

		устойчивого развития	<p>критерии, условия.</p> <p>Методика анализа и оценки рисков, кризисов и их влияния на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования финансового состояния, формирования стратегии и финансовой модели устойчивого развития: составление структурно-логических схем, классификационных схем; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	
	2.2	Оценка инвестиционной привлекательности и чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Выбор инвестиционных проектов и формирование портфеля проектов.	<p>Цели, задачи; понятийный аппарат оценки инвестиционной привлекательности; методы оценки инвестиционной привлекательности, чувствительности проектов долгосрочных инвестиций, выбора проектов и методы формирования портфеля проектов; виды моделей; системы показателей.</p> <p>Методики выбора инвестиционных проектов и формирования портфеля проектов: составление структурно-логических схем,</p>	20

			<p>классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	
3	3.1	<p>Анализ и оценка влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности</p>	<p>Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; методы анализа и оценки; системы показателей; тактические и стратегические задачи; критерии, условия. Методика анализа и оценки влияния рисков инвестиционного проекта на изменения в бухгалтерском балансе, отчете о финансовых результатах в целях прогнозирования инвестиционной активности: составление структурно-логических схем, классификационных схем; задачи; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/com</p>	24

			any.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)	
	3.2	Инвестиционное планирование, прогнозирование, прогнозирование рисков инвестиционного проекта. Инвестиционная политика для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности	<p>Цели, задачи, информационное обеспечение; сравнение понятийного аппарата в отечественной и зарубежной практике; модели и методы инвестиционной политики с учетом тактических и стратегических задач; критерии, условия. Модели и методы прогнозирования рисков инвестиционного проекта.</p> <p>Основные этапы разработки инвестиционного плана, составление прогноза инвестиционной политики на основе результатов финансового анализа, оценки рисков, оценки финансовых и капитальных инвестиций для достижения устойчивого развития, экономического роста деятельности: составление структурно-логических схем, классификационных схем; сквозная методическая работа по теме на материалах российской компании (выбор компании осуществляется на портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141), на информационных порталах выбранной компании)</p>	24

4. Фонд оценочных средств для проведения текущей и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Фонд оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины представлен в приложении.

[Фонд оценочных средств](#)

5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

5.1. Основная литература

5.1.1. Печатные издания

1. 1 Голубева, Татьяна Михайловна. Анализ финансово-хозяйственной деятельности : учеб. пособие / Голубева Татьяна Михайловна. - Москва : Академия, 2008. - 208 с. - (Начальное профессиональное образование). - ISBN 978-5-7695-4571-9 : 203-00.

2. 2 Савицкая, Глафира Викентьевна. Анализ хозяйственной деятельности : учеб. пособие / Савицкая Глафира Викентьевна. - 4-е изд., испр. доп. - Москва : ИНФРА-М, 2007. - 288 с. - (Вопрос-ответ). - ISBN 5-16-002748-7 : 266-00.

5.1.2. Издания из ЭБС

1. 1. Воронцовский, А. В. Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 391 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12441-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/476569> (дата обращения: 03.11.2021).

2. 2. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/487735> (дата обращения: 03.11.2021).

3. 3. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 182 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05843-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/473824>

4. 4. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401> (дата обращения: 03.11.2021).

5.2. Дополнительная литература

5.2.1. Печатные издания

1. 1 Ковалев, Валерий Викторович. Анализ хозяйственной деятельности предприятия : учебник / Ковалев Валерий Викторович, Волкова Ольга Николаевна. - Москва : Проспект, 2006. - 424 с. - ISBN 5-482-00237-3 : 150-00.

2. 2 Крылов, Эдуард Иванович. Анализ финансовых результатов, рентабельности и себестоимости продукции : учеб. пособие / Крылов Эдуард Иванович, Власова Виктория Михайловна, Журавкова Ирина Васильевна. - Москва : Финансы и статистика, 2006. - 720с. - ISBN 5-279-02723-5 : 260-00.

5.2.2. Издания из ЭБС

1. 1. Борисова, О. В. Инвестиции в 2 т. Т. 1. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов / О. В. Борисова, Н. И. Малых, Л. В. Овешникова. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 218 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01718-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469191> (дата обращения: 03.11.2021).

2. 2. Борисова, О. В. Инвестиции в 2 т. Т. 2. Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / О. В. Борисова, Н. И. Малых, Л. В. Овешникова. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 309 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01798-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/434137> (дата обращения: 03.11.2021).

3. 3. Кузнецов, Б. Т. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов / Б. Т. Кузнецов. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 363 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02215-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469018> (дата обращения: 03.11.2021).

4.

5.3. Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

Название	Ссылка
«Консультант+»,	http://www.consultant.ru/
сайт Министерства финансов РФ	https://www.minfin.ru/
Центр раскрытия корпоративной информации	https://www.e-disclosure.ru/

6. Перечень программного обеспечения

Программное обеспечение общего назначения: ОС Microsoft Windows, Microsoft Office, АBBYY FineReader, ESET NOD32 Smart Security Business Edition, Foxit Reader, АИБС "МегаПро".

Программное обеспечение специального назначения:

1) MOODLE

2) Mozilla Firefox

3) Система ГАРАНТ

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Наименование помещений для проведения учебных занятий и для самостоятельной работы обучающихся	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Состав оборудования и технических средств обучения указан в паспорте аудитории, закрепленной расписанием по факультету
Учебные аудитории для проведения практических занятий	
Учебные аудитории для проведения групповых и индивидуальных консультаций	Состав оборудования и технических средств обучения указан в паспорте аудитории, закрепленной расписанием по кафедре

8. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины

Для организации самостоятельной работы студентов используются Методические рекомендации по разработке методического обеспечения самостоятельной работы студентов МР 7.3.03-01-2014.

Работа по организации СРС включает следующие этапы:

1. Выбор отчетных документов компании на интернет-сайтах компаний и на информационном портале «Центр раскрытия корпоративной информации» (<https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=141>), выбор отчетных документов (производственных, учетных) для самостоятельного изучения их студентами и сбора информации для работы – по задачам, сквозным задачам;
2. Определение расчетных этапов задач, предложенных для самостоятельных расчетов;
3. Обеспечение студентов методиками расчетов и алгоритмами формулировок выводов и рекомендаций;
4. Определение форм и методов контроля выполнения СРС: проверка наличия в тетрадях письменных расчетных работ и проведение учебных дискуссий.

Задачи СРС по освоению дисциплины:

- активизация самостоятельной работы студентов;
- содействие развитию творческого мышления;
- выработка умений и навыков рациональной работы с документами нормативно-законодательного регулирования; уставными, внутренними, эмиссионными, финансовыми отчетными документами компаний;
- выработка умений и навыков использования методики аналитической работы.

В методические указания к практическим занятиям включается следующая информация:

- пакет документов изучаемой компании;
- сформулированное практическое задание на задачу (этап задачи) с определением целей и задач расчетной работы;
- описание методов и методик расчетной работы;
- список используемых источников при подготовке к каждому практическому занятию.

Студенты всех форм обучения информируются о допуске к зачету: все задания, выносимые на самостоятельную работу, должны быть выполнены в соответствии с графиком. Выполненная и представленная к итоговому контролю самостоятельная работа является допуском к зачету. Студенты информируются о критериях получения допуска по результатам самостоятельной работы:

- содержание теоретических вопросов раскрыто в требуемом объеме;
- правильно решены задачи и выполнен весь объем практического задания;
- в требуемом объеме использованы документы нормативно-законодательного регулирования, литературы; отчетность предприятий.

Разработчик/группа разработчиков:
Елена Юрьевна Панченко

Типовая программа утверждена

Согласована с выпускающей кафедрой
Заведующий кафедрой

_____ «___» _____ 20___ г.