

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Сибирский государственный индустриальный университет»  
Кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк

УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по учебной и  
воспитательной работе  
\_\_\_\_\_ М.В. Темлянецв  
подпись  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

Экономическая диагностика инвестиционного рынка

38.04.01 «Экономика»  
(направленность (профиль): «Корпоративная экономика и управление  
инвестиционными проектами»)

Квалификация выпускника  
Магистр

Форма обучения  
Очно-заочная форма

Срок обучения: 2 года 3 месяца

Год начала подготовки 2022

Новокузнецк  
2022

## 1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

- формирование у обучающихся базовых знаний и практических навыков в области инвестиционных рынков, формирование системы профессиональных компетенций на инвестиционных рынках.

Задачами учебной дисциплины являются:

- изучить теоретические основы функционирования инвестиционного рынка;
- изучить методы анализа инвестиционного рынка;
- изучить методы прогнозирования развития инвестиционного рынка.

## 2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.04.01 «Экономика».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

- Коммуникации и риски инвестиционного проекта;
- Устойчивое развитие и стратегия компании;
- Фундаментальная экономика: теория и методы;
- Методология разработки управленческих решений;
- Экономическое обоснование управленческих решений;
- Методики анализа финансовой отчетности;
- Финансовая математика и анализ рынков.

Учебная дисциплина дополняет знания, умения и навыки, получаемые по одновременно изучаемым и последующим дисциплинам:

- Экономическая оценка ресурсного обеспечения бизнеса;
- Механизмы финансирования инвестиционных проектов;
- Управление эффективностью инвестиционного проекта;
- Контроль реализации инвестиционного проекта;
- Производственная практика.

## 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

### – Профессиональные компетенции

Наименование категории	Код и наименование ПК	Код и наименование индикатора достиже-	Планируемые результаты
------------------------	-----------------------	--	------------------------

<b>(группы) ПК</b>		<b>ния ПК</b>	<b>обучения</b>
	ПК-1: Способен управлять эффективностью инвестиционного проекта производства продукции и услуг при его реализации	ПК-1.1 Определяет ресурсы, необходимые для реализации инвестиционного проекта производства продукции и услуг, управляет издержками и оценивает эффективность их использования	<ul style="list-style-type: none"> <li>– знать: основы оценки и реализации инвестиционных проектов.</li> <li>– уметь: определять ресурсы, необходимые для проекта, управлять издержками.</li> <li>– владеть: методами управления инвестиционных проектов и их эффективностью.</li> </ul>
	ПК-2: Способен управлять рисками инвестиционного проекта производства продукции и услуг	ПК-2.2 Оценивает и ранжирует выявленные риски и разрабатывает мероприятия по управлению ими в рамках реализации инвестиционного проекта	<ul style="list-style-type: none"> <li>– знать: риски присущие инвестиционному рынку.</li> <li>– уметь: оценивать риски инвестиционного рынка и разрабатывать мероприятия по управлению ими.</li> <li>– владеть: навыками и методиками управления рисками инвестиционного рынка.</li> </ul>

#### **4 Объем и содержание учебной дисциплины**

Учебные занятия по учебной дисциплине проводятся в форме контактной работы и в форме самостоятельной работы обучающихся.

Контактная работа обучающихся с педагогическим работником включает в себя занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (семинары, практические занятия, практикумы), промежуточную аттестацию обучающихся и иную контактную работу, предусматривающую групповую или индивидуальную работу обучающихся с педагогическим работником. Контактная работа обучающихся с педагогическим работником может быть аудиторной, внеаудиторной, а также проводиться в электронной информационно-образовательной среде.

## Объем учебной дисциплины

Семестр / курс		<b>ИТОГО</b>	<b>3 семестр</b>
Форма промежуточной аттестации			экзамен
Трудоёмкость	<i>академ. час.</i>	<b>144</b>	<b>144</b>
	<i>зачетных единиц</i>	<b>4</b>	<b>4</b>
Лекции, <i>академ. час.</i>		<b>6</b>	<b>6</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Лабораторные работы, <i>академ. час.</i>		<b>0</b>	<b>0</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Практические занятия, <i>академ. час.</i>		<b>6</b>	<b>6</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Курсовая работа / проект, <i>академ. час.</i>		<b>0</b>	<b>0</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Консультации, <i>академ. час.</i>		<b>0</b>	<b>0</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Самостоятельная работа, <i>академ. час.</i>		<b>114</b>	<b>114</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>
Контроль, <i>академ. час.</i>		<b>18</b>	<b>18</b>
в форме практической подготовки		<b>0</b>	<b>0</b>

## Содержание учебной дисциплины

Раздел 1 Роль аналитиков на инвестиционных рынках и методы прогнозирования (Инвестиционная среда и инвестиционный климат. Роль государства в развитии инвестиционного рынка. Инвестиционная среда в России. Конфликты интересов и качество прогноза. Методы прогнозирования результатов инвестирования);

Раздел 2 Анализ риска инвестирования (Традиционные показатели измерения риска инвестиционного актива. Безрисковые активы. Возможности снижения риска. Портфельные меры риска. Классические показатели риска для инвестиционных портфелей);

Раздел 3 Влияние поведения инвесторов, инфраструктуры рынков на ценообразование активов (Классическое понимание поведения инвестора. Сила информации и формирование цен. Теория рыночной микроструктуры. Влияние психологии на инвестиционное поведение. Причины возникновения пузырей на инвестиционных рынках.).

### 5 Перечень тем лекций

№ раздела / темы дисциплины	Темы лекций	Трудоемкость, <i>академ. час</i>	
		всего	в форме практической подготовки
Раздел 1.	Роль аналитиков на инвестиционных рынках и методы прогнозирования	2	
Раздел 2.	Анализ риска инвестирования	2	

Раздел 3.	Влияние поведения инвесторов, инфраструктуры рынков на ценообразование активов	2	
<b>Итого:</b>		<b>6</b>	<b>0</b>

### 6 Перечень тем практических занятий (семинаров)

№ раздела / темы дисциплины	Темы практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, академ. час	
		всего	в форме практической подготовки
Раздел 1.	Роль аналитиков на инвестиционных рынках и методы прогнозирования	2	
Раздел 2.	Анализ риска инвестирования	2	
Раздел 3.	Влияние поведения инвесторов, инфраструктуры рынков на аномалии в ценообразовании активов	2	
<b>Итого:</b>		<b>6</b>	<b>0</b>

### 7 Перечень тем лабораторных работ

№ раздела / темы дисциплины	Темы лабораторных работ	Трудоемкость, академ. час	
		всего	в форме практической подготовки
	<i>Отсутствуют</i>		
<b>Итого:</b>		<b>0</b>	<b>0</b>

### 8 Перечень тем курсовых работ (проектов)

№ раздела / темы дисциплины	Темы курсовых работ (проектов)	Трудоемкость, академ. час	
		всего	в форме практической подготовки
	<i>Отсутствуют</i>		
<b>Итого:</b>		<b>0</b>	<b>0</b>

### 9 Виды самостоятельной работы

№ раздела / темы дисциплины	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, академ. час	
		всего	в форме практической подготовки
Раздел 1.	1. Изучение лекционного ма-	38	

	териала; 2. Подготовка к практическому занятию; 3. Прохождение тестирования.		
Раздел 2.	1. Изучение лекционного материала; 2. Подготовка к практическому занятию; 3. Прохождение тестирования.	38	
Раздел 3.	1. Изучение лекционного материала; 2. Подготовка к практическому занятию; 3. Прохождение тестирования.	38	
Контроль	Подготовка к экзамену	18	
<b>Итого:</b>		<b>132</b>	<b>0</b>

## 10 Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины

### а) литература:

1 Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для вузов / Д. В. Кузнецов [и др.] ; под общей редакцией Д. В. Кузнецова. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 289 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13779-8. — URL: <https://urait.ru/bcode/489471> (дата обращения: 28.02.2022);

2 Румянцева, Е. Е. Инвестиционный анализ : учебное пособие для вузов / Е. Е. Румянцева. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 281 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10389-2. — URL: <https://urait.ru/bcode/491401> (дата обращения: 28.02.2022);

3 Зайцев, Ю. К. Инвестиционный климат : учебное пособие для вузов / Ю. К. Зайцев. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 123 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08261-6. — URL: <https://urait.ru/bcode/493256> (дата обращения: 28.02.2022);

4 Погодина, Т. В. Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для вузов / Т. В. Погодина. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 311 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00485-4. — URL: <https://urait.ru/bcode/489483> (дата обращения: 28.02.2022).

### б) ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1 Консультант студента. Электронная библиотека технического ВУЗа : электронно-библиотечная система / ООО «Политехресурс». — Москва, [200 – ]. — URL: <http://www.studentlibrary.ru>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей;

2 НАУЧНАЯ ЭЛЕКТРОННАЯ БИБЛИОТЕКА eLIBRARY.RU : база данных / ООО «НЭБ». – Москва, [200 – ]. – URL: <http://elibrary.ru>. – Режим доступа: по подписке;

3 Образовательная платформа ЮРАЙТ / ООО «Электронное издательство Юрайт». – Москва, [200 – ]. – URL: <https://urait.ru>. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

4 Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система / ООО «Директ-Медиа». – Москва, [200 – ]. – URL: <http://www.biblioclub.ru>. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

5 Электронная библиотека // Научно-техническая библиотека СибГИУ : сайт. – Новокузнецк, [200 – ]. – URL: <http://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp>. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

6 Электронный каталог : сайт / Научно-техническая библиотека СибГИУ. – Новокузнецк, [199 – ]. – URL: <http://libr.sibsiu.ru>.

**в) лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:**

- 7-Zip;
- ABBYY FineReader 11;
- Kaspersky Endpoint Security;
- Microsoft Office 2003;
- Microsoft Office 2007;
- Microsoft Office 2010.

**г) базы данных и информационно-справочные системы:**

1 КонсультантПлюс : справочно-правовая система / ООО «Информационный центр АНВИК». – Новокузнецк, [199 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть библиотеки Сиб. гос. индустр. ун-та.;

2 Система ГАРАНТ : электронный периодический справочник / ООО «Правовой центр «Гарант». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.;

3 Техэксперт : информационно-справочная система / ООО «Группа компаний «Кодекс». – Кемерово, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.;

4 Электронный реферативный журнал (ЭлРЖ) : база данных / ВИНТИ РАН. – Москва, [200 – ]. – Режим доступа: компьютерная сеть библиотеки Сиб. гос. индустр. ун-та.

## **11 Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины**

Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины включает учебные аудитории, оснащенные оборудованием, компьютерной техникой, и техническими средствами обучения, в том числе: - учебную аудиторию для проведения занятий лекционного типа, оборудованную учебной доской, экраном и мультимедийным проектором;

- учебную аудиторию для проведения занятий семинарского типа (практических занятий), оснащенную компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, научно-техническую библиотеку СибГИУ;
- учебную аудиторию (помещения) для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации;
- помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, научно-техническую библиотеку СибГИУ.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) 38.04.01 «Экономика».

Составитель(и):

доцент Климашина Юлия Сергеевна (кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк).

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и утверждена на заседании кафедры.



## Приложение А

### Аннотация

рабочей программы дисциплины «Экономическая диагностика инвестиционного рынка»

по направлению подготовки (специальности)

**38.04.01 «Экономика»**

(направленность (профиль): «Корпоративная экономика и управление инвестиционными проектами»)

форма обучения – Очно-заочная форма

### 1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

- формирование у обучающихся базовых знаний и практических навыков в области инвестиционных рынков, формирование системы профессиональных компетенций на инвестиционных рынках.

Задачами учебной дисциплины являются:

- изучить теоретические основы функционирования инвестиционного рынка;
- изучить методы анализа инвестиционного рынка;
- изучить методы прогнозирования развития инвестиционного рынка.

### 2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.04.01 «Экономика».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

- Коммуникации и риски инвестиционного проекта;
- Устойчивое развитие и стратегия компании;
- Фундаментальная экономика: теория и методы;
- Методология разработки управленческих решений;
- Экономическое обоснование управленческих решений;
- Методики анализа финансовой отчетности;
- Финансовая математика и анализ рынков.

Учебная дисциплина дополняет знания, умения и навыки, получаемые по одновременно изучаемым и последующим дисциплинам:

- Экономическая оценка ресурсного обеспечения бизнеса;
- Механизмы финансирования инвестиционных проектов;
- Управление эффективностью инвестиционного проекта;

- Контроль реализации инвестиционного проекта;
- Производственная практика.

### 3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

#### – Профессиональные компетенции

Наименование категории (группы) ПК	Код и наименование ПК	Код и наименование индикатора достижения ПК	Планируемые результаты обучения
	ПК-1: Способен управлять эффективностью инвестиционного проекта производства продукции и услуг при его реализации	ПК-1.1 Определяет ресурсы, необходимые для реализации инвестиционного проекта производства продукции и услуг, управляет издержками и оценивает эффективность их использования	<ul style="list-style-type: none"> <li>– знать: основы оценки и реализации инвестиционных проектов.</li> <li>– уметь: определять ресурсы, необходимые для проекта, управлять издержками.</li> <li>– владеть: методами управления инвестиционных проектов и их эффективностью.</li> </ul>
	ПК-2: Способен управлять рисками инвестиционного проекта производства продукции и услуг	ПК-2.2 Оценивает и ранжирует выявленные риски и разрабатывает мероприятия по управлению ими в рамках реализации инвестиционного проекта	<ul style="list-style-type: none"> <li>– знать: риски присущие инвестиционному рынку.</li> <li>– уметь: оценивать риски инвестиционного рынка и разрабатывать мероприятия по управлению ими.</li> <li>– владеть: навыками и методиками управления рисками инвестиционного рынка.</li> </ul>

#### 4 Объем учебной дисциплины

Семестр / курс		<b>ИТОГО</b>	<b>3 семестр</b>
Форма промежуточной аттестации			<b>экзамен</b>
Трудоёмкость	академ. час.	<b>144</b>	<b>144</b>
	зачетных единиц	<b>4</b>	<b>4</b>
Лекции, академ. час.		<b>6</b>	<b>6</b>

в форме практической подготовки	0	0
Лабораторные работы, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Практические занятия, <i>академ. час.</i>	6	6
в форме практической подготовки	0	0
Курсовая работа / проект, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Консультации, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Самостоятельная работа, <i>академ. час.</i>	114	114
в форме практической подготовки	0	0
Контроль, <i>академ. час.</i>	18	18
в форме практической подготовки	0	0

## 5 Краткое содержание учебной дисциплины

В структуре учебной дисциплины выделяются следующие основные разделы (темы):

Раздел 1 Роль аналитиков на инвестиционных рынках и методы прогнозирования (Инвестиционная среда и инвестиционный климат. Роль государства в развитии инвестиционного рынка. Инвестиционная среда в России. Конфликты интересов и качество прогноза. Методы прогнозирования результатов инвестирования);

Раздел 2 Анализ риска инвестирования (Традиционные показатели измерения риска инвестиционного актива. Безрисковые активы. Возможности снижения риска. Портфельные меры риска. Классические показатели риска для инвестиционных портфелей);

Раздел 3 Влияние поведения инвесторов, инфраструктуры рынков на ценообразование активов (Классическое понимание поведения инвестора. Сила информации и формирование цен. Теория рыночной микроструктуры. Влияние психологии на инвестиционное поведение. Причины возникновения пузырей на инвестиционных рынках.).

## 6 Составитель(и):

доцент Климашина Юлия Сергеевна (кафедра экономики, учета и финансов. АО Кузнецкбизнесбанк).