Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 10.11.2026 20:46:32
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского»

КАФЕДРА БАНКОВСКОГО ДЕЛА

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебно-методической работе

_____ Л. В. Крылова

«24» марта 2026 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.03 ИНВЕСТИЦИОННАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ БАНКОВ

(название дисциплины)

Укрупненная группа направлений подготовки: 38.00.00 Экономика и управление (код, наименование)

Образовательная программа высшего образования: программа магистратуры

Направление подготовки: 38.04.08 Финансы и кредит (код, наименование)

Магистерская программа: Банковское дело (наименование)

Институт: учета и финансов

Форма обучения, курс: очная форма обучения, 1 курс; заочная форма обучения, 1 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2026

Рабочая программа дисциплины «Инвестиционная деятельность банков» для обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, Магистерской программы: Банковское дело, разработанная в соответствии с с ОПОП ВО, для набора обучающихся 2026 года.

Разработчик: Кушнир Ирина Николаевна, доцент, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры банковского дела
Протокол от «10» февраля 2026 года № 11
Зав. кафедрой банковского дела

_____ И.В. Попова
(подпись) (инициалы, фамилия)

СОГЛАСОВАНО
Директор Института учета и финансов

_____ Л.И. Тымчина
(подпись) (инициалы, фамилия)

«24» февраля 2026 года

ОДОБРЕНО
Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»
Протокол от «25» марта 2026 года № 8

Председатель _____ Л.В. Крылова
(подпись)

© Кушнир И.Н., 2026 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2026 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателей</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки/специальностей, направление подготовки/специальность, профиль/магистерская программа/специализация, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика учебнойдисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>заочная форма обучения</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Количество зачетных единиц – 2</td><td>Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление</td><td colspan="2" rowspan="2">Часть, формируемая участниками образовательных отношений</td></tr>
<tr><td>Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит</td></tr>
<tr><td rowspan="4">Модулей – 1
Смысловых модулей - 2
Общее количество часов – 72</td><td rowspan="4">Магистерская программа: Банковское дело</td><td colspan="2">Год подготовки:</td></tr>
<tr><td>1-й</td><td>1-й</td></tr>
<tr><td colspan="2">Семестр</td></tr>
<tr><td>2-й</td><td>2-й</td></tr>
<tr><td rowspan="15">Количество часов внеделю:

аудиторных – 1,88,
самостоятельной работы обучающегося – 2,05.</td><td rowspan="15">Программа высшего образования: программа магистратура</td><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td>18 час.</td><td>6 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>16 час.</td><td>6час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные работы</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>36,85 час.</td><td>56,85 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания*:</td></tr>
<tr><td>2 ТМК</td><td>2 ТМК</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации: (зачет, экзамен)</td></tr>
<tr><td>зачет</td><td>зачет</td></tr>
</table>

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 2ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

для заочной формы обучения указывается, при наличии, аудиторная письменная работа/контрольная работа (АПР), курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:

для очной формы обучения – 34/36,85.

для заочной формы обучения – 12/56,85.

2. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель: изучение обучающимися теоретических знаний о сущности, способах осуществления и целях инвестиционной деятельности банков, методическими подходами к оценке рискованности и эффективности банковских инвестиций, практическими навыками управления инвестиционными операциями банков.

Задачи:

получение студентами совокупности знаний об инвестиционных тенденциях в соответствии с параметрами действующих стандартов;

приобретение навыков формализованного описания и алгоритмического представления инвестиционного проекта;

приобретение навыков оценки критериев эффективности инвестиционной деятельности с помощью современных методов экономического анализа;

изучение вопросов организации и подготовки проектных заданий, проектов и программ;

получение навыков диагностики финансово-экономических рисков, идентификация и оценка рисков банковской деятельности при принятии финансовых решений;

проведение сравнительного анализа проектов различной продолжительности.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.03 «Инвестиционная деятельность банков» относится части профессионального цикла основной образовательной программы по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (Магистерская программа: Банковское дело), формируемой участниками образовательных отношений.

Логически и содержательно-методически учебная дисциплина «Инвестиционная деятельность банков» связана с предшествующим освоением таких частей Основной образовательной программы, как: дисциплины «Актуальные проблемы финансов», «Финансовый анализ (продвинутый уровень)», «Математическое обеспечение финансовых решений», «Финансовый менеджмент», «Информационное обеспечение управления банком», «Система риск-менеджмента в банках», «Теория и практика финансовой устойчивости кредитной организации», «Финансовый менеджмент в банке», «Кредитование как банковскийбизнес-процесс», учебная практика (виртуальная практика), научно-исследовательская работа студентов (НИР).

Для успешного освоения учебной дисциплины обучающиеся должны обладать «входными» знаниями, умениями и готовностями, которые позволяют решать следующие профессиональные задачи:

- сбор, анализ и оценка финансово-экономической информации для проведения финансовых расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений;
- проведение комплексного финансового анализа деятельности клиентов банков,банковских учреждений;
- управление движением денежных потоков, формированием и использованиемфинансовых ресурсов предприятий, организаций, учреждений;
- подготовка проектных заданий, проектов и программ;
- диагностика финансово-экономических рисков, идентификация и оценка рисковбанковской деятельности при принятии финансовых решений;
- исследование актуальных проблем в сфере финансов и кредита, банковского дела.

Изучение учебной дисциплины «Инвестиционная деятельность банков» необходимо для успешного освоения следующих частей Основной образовательной программы: дисциплин «Международное корпоративное и банковское право», «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты», «Маркетинг в банке», «Новые банковские технологии», прохождение производственной практики (производственной преддипломной практики), выполнение научно-исследовательской работы студентов (НИР), выполнение и защита магистерской диссертации.

4. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

В результате освоения изучения учебной дисциплины у обучающегося должны быть сформированы **компетенции** и **индикаторы их достижения**:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	ИД-1УК-2. Понимает принципы проектного подхода к управлению ИД-2УК-2. Демонстрирует способность управления проектами
ПК-7. Способен осуществлять финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	ИД-5ПК-7.Осуществляет консультирование клиентов по вопросам управления инвестиционным портфелем

В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны:

знать: содержание, основные направления и инструменты инвестиционной банковской деятельности; методы математического, статистического и экономического анализа инвестиционных операций и диагностики проблем, связанных с инвестиционной деятельностью коммерческого банка; состав инвестиционного портфеля банка, классификацию инвестиционных рисков и причины их возникновения; методы управления инвестиционным портфелем, принципы формирования оптимального инвестиционного портфеля банка; механизм осуществления инвестиционных операций банков на рынке ценных бумаг;

уметь: оценивать качество и доходность инвестиционных активов и инвестиционного портфеля банка на основе системы показателей; проводить классификацию эмитентов ценных бумаг по категориям риска и оценивать уровень рисков инвестиционной деятельности банка; оценивать эффективность инвестиционных проектов; обосновывать направления инвестиционной политики банка; принимать обоснованные управленческие решения по повышению качества и доходности инвестиционного портфеля банка;

владеть: способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления, способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов, способностью на основе комплексного экономического и финансового анализа дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления, способностью осуществлять самостоятельно или руководить подготовкой заданий и разработкой финансовых аспектов проектных решений и соответствующих нормативных и методических документов для реализации

подготовленных проектов, способностью предложить конкретные мероприятия по реализации разработанных проектов и программ, способностью оценивать финансовую эффективность разработанных проектов с учетом оценки финансово-экономических рисков и фактора неопределенности, способностью оказать консалтинговые услуги коммерческим и некоммерческим организациям различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, по вопросам совершенствования их финансовой деятельности, способностью провести консалтинговые исследования финансовых проблем по заказам хозяйствующих субъектов, включая финансово-кредитные организации, органов государственной власти и органов местного самоуправления.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. ИНВЕСТИЦИОННАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ БАНКОВ

Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков.

Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков.

Тема 2. Инвестиционная политика банков.

Тема 3. Механизм осуществления посреднических и собственных операции банков нарынке ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков.

Тема 4. Инвестиционный бэнкинг: деятельность инвестиционных банков на рынке слияний и поглощений андеррайтинг.

Тема 5. Инвестиционно-проектное банковское финансирование.

Тема 6. Инвестиционные риски банка.

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						заочная форма обучения					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л	п	лаб	инд	СРС		л	п	лаб	инд	СРС
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1. Инвестиционная деятельность банков												
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков.												
Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков.	12	3	3	-	-	6	11	1	1	-	-	9
Тема 2.Инвестиционная политика банков.	12	3	3	-	-	6	11	1	1	-	-	9

Тема 3. Механизм осуществления посреднических и собственных операции банков на рынке ценных бумаг.	12	3	3	-	-	6	11	1	1	-	-	9
Итого по смысловому модулю 1	***36***	***9***	***9***	***-***	***-***	***18***	***33***	***3***	***3***	***-***	***-***	***27***
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков.												
Тема 4. Инвестиционный бэнкинг: деятельность инвестиционных банков на рынке слияний и поглощений, андеррайтинг.	12	3	3	-	-	6	11	1	1	-	-	9
Тема 5. Инвестиционно-проектное банковское финансирование.	11	3	2	-	-	6	11	1	1	-	-	9
Тема 6. Инвестиционные риски банка.	11,85	3	2	-	-	6,85	13,85	1	1	-	-	11,85
Итого по смысловому модулю 2	***34,85***	***9***	***7***	***-***	***-***	***20***	***35,85***	***3***	***3***	***-***	***-***	***29,85***
Итого по смысловым модулям	**70,85**	**18**	**16**	**-**	**-**	**36,85**	**68,85**	**6**	**6**	**-**	**-**	**56,85**
Катт	***0,9***	**-**	**-**	***0,9***	**-**	**-**	***0,9***	**-**	**-**	***0,9***	**-**	**-**
СРэк	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
ИК	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
КЭ	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
Каттэк	***0,25***	**-**	**-**	**-**	***0,25***	**-**	***0,25***	**-**	**-**	**-**	***0,25***	**-**
Контроль	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**2**	**-**	**-**	**2**	**-**	**-**
Всего часов	***72***	***18***	***16***	***0,9***	***0,25***	***36,85***	***72***	***6***	***6***	***2,9***	***0,25***	***56,85***

Примечания: л – лекции; п – практические (семинарские) занятия; лаб – лабораторные занятия; инд – индивидуальные задания; СРС – самостоятельная работа;

7. ТЕМЫ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		Очная форма	Заочная форма
1	2	3	4
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков.			
1	Теоретические основы инвестиционной деятельности банков	3	1
2	Инвестиционная политика банков	3	1
3	Механизм осуществления посреднических и собственных операции банков на рынке ценных бумаг	3	1
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков.			
4	Инвестиционный бэнкинг: деятельность инвестиционных банков на рынке слияний и поглощений, андеррайтинг.	3	1
5	Инвестиционно-проектное банковское финансирование	2	1

6	Инвестиционные риски банка.	2	1
	Всего	**16**	**6**

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма обучения	заочная форма обучения
	не предусмотрено		

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков.			
1	Консультирование по стратегии, тактике и выбору целей для слияния и поглощения.	6	9
2	Финансовый лизинг как форма инвестиционного кредитования. Целесообразность обращения к финансовому лизингу.	6	9
3	Основные схемы секьюритизации активов.	6	9
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков.			
4	Представление интересов клиентов при проведенииисделок по слияниям и поглощениям.	6	9
5	Программные продукты, разработанные для количественной оценки инвест проектов	6	9
6	Проведение операций маклера и брокера в сфере слияний и поглощений.	6,85	11,85
	Всего	**36,85**	**56,85**

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или заменяются устным ответом;

2) для глухих и слабослышащих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- экзамен и зачёт проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания заменяются устным ответом;
- экзамен и зачёт проводятся в устной форме.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом. или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:
- в печатной форме увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа.

2) для глухих и слабослышащих:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

11. ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

1. Инвестиционные операции банка – это:

А) вложения денежных и иных резервов банка в ценные бумаги, недвижимость, уставные фонды предприятий от своего имени и по своей инициативе с целью получения прямых и косвенных доходов;

Б) анализ и оценка инвестиционной политики;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

2. Прямые доходы от вложений в ценные бумаги банк получает в форме:

А) дивидендов, процентов или прибыли от перепродажи;

Б) операций на рынке ценных бумаг;

В) аккумулирования финансовых ресурсов;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

3. Косвенные доходы банка от вложений в ценные бумаги образуются:

А) за счет расширения доли рынка, контролируемого банком, через дочерние изависимые общества;

Б) за счет усиления их влияния на клиентов путем участия в корпоративном управлениина основе владения пакетом их акций;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

4. Портфельное инвестирование состоит из следующих этапов:

А) формирование стартового портфеля, реструктуризация портфеля;

Б) построениетактики инвестиционной деятельности;

В) выбор операций с ценными бумагами;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

5. Андеррайтинг – это:

А) брокерские операции;

Б) анализ, оценка и установление предварительной цены выпускаемой ценной бумаги,подписка, первичное размещение акций компаний-эмитентов;

В) сделки по реструктуризации предприятий;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

6. Банковский инвестиционный портфель представляет собой:

А) совокупность средств, вложенных в ценные бумаги сторонних юридических лиц,приобретенных банком;

Б) анализ, оценка и установление предварительной цены выпускаемой ценной бумаги,подписка, первичное размещение акций компаний-эмитентов;

В) выбор операций с ценными бумагами;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

7. Инвестиционная деятельность кредитных организации на рынке ценных бумагрегулируется следующими документами:

А) уставом банка;

Б) акционерным законодательством, законодательством о рынке ценных бумаг,

В) исключительно банковским законодательством;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

8. С целью ограничения рисков, связанных с операциями с ценными бумагами, ЦБ длякоммерческих банков:

А) устанавливает обязательные экономические нормативы, определяет порядок расчета кредитного и рыночного рисков кредитных организаций и ограничивает их размер;

Б) устанавливает правила переоценки вложений в ценные бумаги и создания резервовпод различные виды риска по операциям с ценными бумагами;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

9. Операции банков с ценными бумагами можно разделить на:

А) активные и пассивные; фондовые и коммерческие;

Б) эмиссионные, торговые, сохранные, доверительные, гарантийные;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

10. По критерию цели проведения операции банков с ценными бумагами делятся на:

А)операции по управлению долгом, по управлению средствами клиентов;

Б) операции хеджирования;

В) операции с чеками;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

11. Деятельность банков на рынке ценных бумаг можно разделить на такие виды:

А) деятельность как эмитентов и как инвесторов;

Б) профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

12. В качестве профессиональных участников рынка ценных бумаг банки могут осуществлять следующие виды деятельности:

А) дилерская, брокерская, деятельность по доверительному управлению, депозитарная,клиринговая;

Б) кредитование субъектов хозяйствования;

В) операции по хеджированию;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

13. Дилерская деятельность – это:

А) оказание услуг по хранению сертификатов ценных бумаг и (или) учету и переходу прав на ценные бумаги;

Б) совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счет путем публичного объявления цен покупки и/или продажи определенных ценных

бумаг с обязательством покупки и/или продажи этих ценных бумаг по объявленным ценам;

В) совершение сделок с ценными бумагами в качестве поверенного или комиссионера, действующего на основании договоров поручения или комиссии, а также доверенности на совершение таких сделок;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

14. Брокерская деятельность – это:

А) совершение сделок с ценными бумагами в качестве поверенного или комиссионера, действующего на основании договоров поручения или комиссии, а также доверенности на совершение таких сделок;

Б) совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счет путем публичного объявления цен покупки и/или продажи определенных ценных бумаг с обязательством покупки и/или продажи этих ценных бумаг по объявленным ценам;

В) операции банков по управлению денежными средствами клиентов, предназначенными для инвестирования в ценные бумаги, ценными бумагами клиентов;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

15. Деятельность по доверительному управлению подразумевает;

А) операции банков по управлению денежными средствами клиентов, предназначенными для инвестирования в ценные бумаги, ценными бумагами клиентов, а также денежными средствами и ценными бумагами клиентов, полученными в процессе управления в интересах и по поручению клиентов на правах доверительного лица от своего имени за вознаграждение в течение определенного срока;

Б) оказание услуг по хранению сертификатов ценных бумаг и (или) учету и переходу прав на ценные бумаги;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

16. Депозитарная деятельность – это:

А) оказание услуг по хранению сертификатов ценных бумаг и (или) учету и переходуправ на ценные бумаги;

Б) операции банков по управлению денежными средствами клиентов, предназначенными для инвестирования в ценные бумаги, ценными бумагами клиентов;

В) кредитование субъектов хозяйствования;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

17. Брокерская деятельность, дилерская деятельность, деятельность по управлениюценными бумагами и депозитарная деятельность могут осуществляться:

А) несколькими банками;

Б) одним банком, имеющим лицензию на осуществление соответствующих видовпрофессиональной деятельности;

В) любым предприятием;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

18. Отличительным признаком рынка слияний и поглощений является:

А) направленная деятельность по реструктуризации бизнеса, с целью приведения его в оптимальное соответствие постоянно меняющимся рыночным условиям;

Б) причины возникновения спроса на инвестиционные услуги банков;

В) деятельность банков как профессиональных участников рынка ценных бумаг;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

19. Значительное увеличение притока в страну иностранного банковского

капиталанаходит свое отражение:

А) в росте количества сделок по покупке иностранными банками крупных пакетовакций российских финансовых институтов;

Б) в росте количества банков;

В) в росте трансграничных сделок;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

20. Тенденция по поглощению/покупке существенных пакетов акций иностранных компаний крупнейшими корпорациями – лидерами в своих секторах обуславливается:

А) ростом количества банковских учреждений;

Б) появившимися в распоряжении таких компаний значительными объемами свободных финансовых ресурсов и стремлением к страновой диверсификации бизнеса и хеджированию рисков, связанных с сосредоточением бизнеса исключительно в одной стране;

В) верны оба варианта;

Г) правильный вариант ответа отсутствует.

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по учебной дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по учебной дисциплине по очной форме обучения*

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1-6)	7	42
- разноуровневые задачи и задания (темы 1-6)	7	42
- тестирование (ТМК 1)	8	8
- тестирование (ТМК 2)	8	8
Промежуточная аттестация	*зачет*	*100*
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине по заочной форме обучения*

Форма контроля	**Максимальное количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1-6)	7	42
- разноуровневые задачи и задания (темы 1-6)	7	42
- тестирование (ТМК 1)	8	8
- тестирование (ТМК 2)	8	8
Промежуточная аттестация	*зачет*	*100*
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к зачету:

1. Основные понятия инвестиций и инвестиционной деятельности.
2. Экономическая сущность и управление инвестициями.
3. Классификация и виды инвестиций.
4. Факторы, воздействующие на инвестиционную деятельность.
5. Объекты инвестиционной деятельности.
6. Субъекты инвестиционной деятельности.
7. Прибыль как источник инвестиций.
8. Основные составляющие инвестиционного рынка.
9. Роль государства в регулировании инвестиционной деятельности.
10. Формы и методы государственного регулирования инвестиционной деятельности.
11. Нормативно-правовое обеспечение инвестиционной деятельности.
12. Регулирование инвестирования в реальные активы и ценные бумаги.
13. Структура и состояние инвестиционного рынка.
14. Рынок инвестиционных ресурсов и услуг.
15. Инвестиционный рынок недвижимости и основных фондов.
16. Анализ инвестиционного рынка.
17. Понятие и виды инвестиционного проекта.
18. Разработка инвестиционного проекта.
19. Методы финансирования инвестиционных проектов.
20. Риски инвестиционных проектов.
21. Формирование инвестиционной политики и стратегии организации.
22. Инвестиционный мониторинг.
23. Экономическая эффективность инвестиционных проектов.
24. Ценные бумаги как составляющие инвестиционного портфеля.
25. Понятие, типы и этапы формирования инвестиционного портфеля.
26. Управление инвестиционным портфелем.
27. Инвестиционный портфель акций и его оптимизация.
28. Управление портфелем облигаций.
29. Управление финансовыми инновациями.
30. Экономические сделки слияний и поглощений и их роль в финансировании инвестиций.
31. Инвестиционная деятельность в рамках государственно-частного партнерства.
32. Лизинговое финансирование инвестиционной деятельности.
33. Оценка инвестиционной привлекательности предприятия.
34. Формирование денежных потоков инвестиционной деятельности.
35. Обеспечение инвестиционной деятельности предприятия.
36. Финансово-экономическая оценка эффективности управления инвестициями предприятия.
37. Экономическая природа и сущность иностранных инвестиций.
38. Классификация и структура иностранных инвестиций.
39. Прямые и портфельные иностранные инвестиции
40. Особенности инвестиционной деятельности транснациональных компаний.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу						**Максимальная сумма баллов**
Смысловой модуль № 1			Смысловой модуль № 2			
50			50			
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	100
14	14	22	14	14	22	

Оценки по результатам промежуточной аттестации выставляются в соответствии со следующими критериями:

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	**По государственной шкале**	**Определение**
90-100	«зачтено»	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
75-89	«зачтено»	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок
60-74	«зачтено»	удовлетворительное выполнение со значительным количеством недостатков
менее 60	«не зачтено»	с возможностью повторной аттестации

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Вдовина, Е.С. Банковский менеджмент: учебно-методическое пособие / Е.С. Вдовина, М.А. Куликова. — Тамбов: Тамбовский государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2023. — 81 с. — ISBN 978-5-8265-2715-3. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141032.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
2. Эриашвили, Н.Д. Банковское право: учебник для студентов вузов, обучающихся по специальностям «Юриспруденция», «Финансы и кредит» / Н.Д. Эриашвили, А.И. Григорьев. — 9-е изд. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 615 с. — ISBN 978-5-238-02788-3. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141779.html (дата обращения: 28.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.

Дополнительная литература:

1. Банковский менеджмент: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / В.И. Абрамов, А.Ф. Барикаева, Е.И. Кузнецова [и др.]; под редакцией Н.Д. Эриашвили. — 6-е изд. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. – 336 с. — ISBN 978-5-238-03501-7. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141518.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
2. Банковское дело. Управление и технологии: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под редакцией А. М. Тавасиева. —

3-е изд. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 663 c. — ISBN 978-5-238-02229-1. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMAR: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141373.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

3. Банковское дело. Управление и технологии: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под редакцией А. М. Тавасиева. — 3-е изд. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 663 c. — ISBN 978-5-238-02229-1. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141373.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
   Масленченков, Ю.С. Финансовый менеджмент банка: учебное пособие для вузов / Ю.С. Масленченков. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 399 c. — ISBN 5-238-00576-8. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141375.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
4. Сазонов, С.П. Банки и банковская деятельность. Банковский менеджмент: учебное пособие / С.П. Сазонов, И.А. Езангина; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Волгоградский государственный технический университет. — Волгоград: ВолгГТУ, 2021. — 76 с. – Локальная компьютерная сеть НБ ДОННУЭТ.
5. Сырбу, А.П. Банковское дело и банковские операции: учебное пособие / А.П. Сырбу, В.И. Меньщикова. — Тамбов: Тамбовский государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2023. — 160 c. — ISBN 978-5-8265-2704-7. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/141034.html (дата обращения: 23.08.2023). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.

Учебно-методические издания:

1. Макухина, Я.О. Инвестиционная деятельность банков [Текст]: конспект лекций / Я.О. Макухина. — Донецк: [ДонНУЭТ], 2023. — Учебно-методический комплекс дисциплины.
2. Макухина, Я.О. Инвестиционная деятельность банков [Текст]: методические указания для практических и семинарских занятий / Я.О. Макухина. — Донецк: [ДонНУЭТ], 2023. — Учебно-методический комплекс дисциплины.

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – Текст : электронный.
2. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999– . – URL:http://catalog.donnuet.ru. – Текст : электронный.
3. Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». – Москва : ООО «Дата Экспресс», 2024– . – Текст : электронный.
4. IPR SMART : весь контент ЭБС Ipr books : цифровой образовательный ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2007 –. – URL:http://www.iprbookshop.ru. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.
5. Лань : электронная-библиотечная система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://e.lanbook.com/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
6. СЭБ : Консорциум сетевых электронных бибилиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://seb.e.lanbook.com/ – Режим доступа :

для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст : электронный.
7. Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, cop. 1997–2024. – URL:https://polpred.com. – Текст : электронный.
8. Book on lime : дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017 –. – URL:https://bookonlime.ru. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.
9. Информио : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информио», 2009 –. – URL: https://www.informio.ru. – Текст : электронный.
10. Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006–. – URL:https://biblioclub.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический унтиниверситет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL:http://liber.rea.ru/login.php. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Финансовый университет, 2019– . – URL:http://library.fa.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
13. Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 – . – URL:https://library.lib.sfedu.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, cop. 2000–2024. – URL:https://elibrary.ru. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст : электронный.
15. CYBERLENINKA : Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012 – . – URL:http://cyberleninka.ru. – Текст : электронный.
16. Национальная электронная библиотека : НЭБ : федеральная государственная информационная система / Министерство культуры Российской Федерации [и др.]. – Москва : Российская государственная библиотека : ООО ЭЛАР, [2008 –]. – URL:https://rusneb.ru/ – Текст. Изображение : электронные.

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ООП ВО магистратуры перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры финансов и экономической безопасности (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

ФИО педагогического (научно-педагогического) работника, участвующего в реализации образовательной программы	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании
Кушнир Ирина Николаевна	По основному месту работы	Должность-доцент, ученая степень-кандидат экономических наук, ученое звание - доцент	1. Высшее. Бухгалтерский учет, контроль и анализ хозяйственной деятельности, экономист. 2. Высшее. Правоведение, специалист по правоведению. 3. Высшее. Управление персоналом и экономика труда, магистр по экономике труда и управлению персоналом. диплом кандидата наук ДК № 004985	1. . Удостоверение о ПК №ПК/23/05/000178, 31.05.2023 «Налоги и налогообложение субъектов цифровой экономики», 144 ч., АНО ДПО "Санкт-Петербургский Межотраслевой Институт Повышения Квалификация", Санкт-Петербург 2. Удостоверение о ПК ПК/23/07/000155, 04.08.2023 «Налоговый учёт и отчётность в условиях цифровизации», 144 ч. АНО ДПО "Санкт-Петербургский Межотраслевой Институт Повышения Квалификация", Санкт-Петербург 3.Удостоверение о ПК №571803581155, 01.06.2023 «Управление устойчивым развитием территорий», 16 ч. ФГБОУ ВО "Орловский государственный университет имени И.С. Тургенева", Орел 4. Удостоверение о ПК №ЦПК/23/06/000015, 30.06.2023 «Налоговая система Российской Федерации», 144 ч. АНОДПО "Центральный Межотраслевой Институт Повышения Квалификации", Москва 5. Удостоверение о ПК №ПК 243001-1, 30.01.2024 «Развитие платформенных моделей и экосистем в банковской сфере», 144 ч. АНОДПО "Учебный центр "Астарта", Симферополь 6. Сертификат о ПК №24/16, 06.06.2024 «Экономика и менеджмент», 8 ч. ФГБОУ ВО "Приазовский государственный технический университет", Мариуполь. 7. Удостоверение о ПК №ПК 252101-1, 21.01.2025 «Трансформация налогового администрирования в условиях диджитализации:: национальные особенности и зарубежный опыт», 144 ч. АНО ДПО "Учебный центр "Астарта", Симферополь 8. Удостоверение о ПК №ЦПК/25/10/2032, 02.10.2025 «Искусственный интеллект в банках:вызовы внедрения цифровых технологий», 144 ч. ООО "Многопрофильный Институт Повышения Квалификации и Центр Консалтинга", .Москва

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.03 ИНВЕСТИЦИОННАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ БАНКОВ

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
(код и наименование)

Магистерская программа: Банковское дело
(наименование)

Трудоемкость учебной дисциплины: 2 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: содержание, основные направления и инструменты инвестиционной банковской деятельности; методы математического, статистического и экономического анализа инвестиционных операций и диагностики проблем, связанных с инвестиционной деятельностью коммерческого банка; состав инвестиционного портфеля банка, классификациюинвестиционных рисков и причины их возникновения; методы управления инвестиционным портфелем, принципы формирования оптимального инвестиционного портфеля банка; механизм осуществления инвестиционных операций банков на рынке ценных бумаг;

уметь: оценивать качество и доходность инвестиционных активов и инвестиционного портфеля банка на основе системы показателей; проводить классификацию эмитентов ценных бумаг по категориям риска и оценивать уровень рисков инвестиционной деятельности банка; оценивать эффективность инвестиционных проектов; обосновывать направления инвестиционной политики банка; принимать обоснованные управленческие решения по повышению качества и доходности инвестиционного портфеля банка;

владеть: способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления, способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов, способностью на основе комплексного экономического и финансового анализа дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления, способностью осуществлять самостоятельно или руководить подготовкой заданий и разработкой финансовых аспектов проектных решений и соответствующих нормативных и методических документов для реализации подготовленных проектов, способностью предложить конкретные мероприятия по реализации разработанных проектов и программ, способностью оценивать финансовую эффективность разработанных проектов с учетом оценки финансово-экономических рисков и фактора неопределенности, способностью оказать консалтинговые услуги коммерческим и некоммерческим организациям различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, по вопросам совершенствования их финансовой деятельности, способностью провести консалтинговые исследования финансовых проблем по заказам хозяйствующих субъектов, включая финансово-кредитные организации, органов государственной власти и органов местного самоуправления.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	ИД-1УК-2. Понимает принципы проектного подхода к управлению ИД-2УК-2. Демонстрирует способность управления проектами
ПК-7. Способен осуществлять финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	ИД-5ПК-7.Осуществляет консультирование клиентов по вопросам управления инвестиционным портфелем

Смысловые модули и темы учебной дисциплины:

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков.

Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков.

Тема 2. Инвестиционная политика банков.

Тема 3. Механизм осуществления посреднических и собственных операции банков нарынке ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков.

Тема 4. Инвестиционный бэнкинг: деятельность инвестиционных банков на рынкеслияний и поглощений, андеррайтинг.

Тема 5. Инвестиционно-проектное банковское финансирование.

Тема 6. Инвестиционные риски банка.

Форма промежуточной аттестации: зачет

Разработчик:
Кушнир И.Н., к.э.н., доцент,
доцент кафедры банковского дела

Заведующий кафедрой банковского дела
Попова И. В., д.э.н., доцент