

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 24.02.2025 09:27:53
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 учебной и методической работе

Л. В. Крылова

« 28 » 02 2024 г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.05 ИНВЕСТИЦИИ В БАНКАХ

(шифр, название учебной дисциплины в соответствии с учебным планом)

Угруппированная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление

Программа высшего образования – программа бакалавриата

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль: Банковское дело

Институт учета и финансов

Форма обучения, курс:

очная форма обучения, 3 курс


очно-заочная форма обучения, 3 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными
возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2024


Рабочая программа учебной дисциплины «Инвестиции в банках» для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профилю: Банковское дело, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»:

- в 2024 г. – для очной формы обучения;
- в 2024 г. – для очно-заочной формы обучения.

Разработчик: Грицак Елена Владимировна, доцент кафедры банковского дела, кандидат экономических наук, доцент 

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры банковского дела
Протокол от 20 февраля 2024 г. № 12

Зав. кафедрой банковского дела

 **КАФЕДРА И.В. Попова**
БАНКОВСКОГО ДЕЛА
(подпись) (инициалы, фамилия)

СОГЛАСОВАНО

Директор института учета и финансов

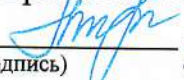
  **Л.И. Тымчина**
(подпись) (инициалы, фамилия)

Дата 21 февраля 2024 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»

Протокол от 28 февраля 2024 № 7

Председатель  **Л.В. Крылова**
(подпись) (инициалы, фамилия)

© Грицак Е.В., 2024 год

© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2024 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование показателя	Наименование укрупненной группы направлений подготовки, направление подготовки, профиль, программа высшего образования	Характеристика учебной дисциплины	
		очная форма обучения	очно-заочная форма обучения
Количество зачетных единиц – 3	Укрупненная группа направлений подготовки 38.00.00 Экономика и управление	Часть, формируемая участниками образовательных отношений	
	Направление подготовки 38.03.01 Экономика		
Модулей – 1	Профиль Банковское дело	Год подготовки	
Смысловых модулей – 2		3-й	3-й
Общее количество часов – 108		Семестр	
	5-й	6-й	
		Лекции	
		18 час.	18 час.
Количество часов в неделю для очной формы обучения: аудиторных – 3 самостоятельной работы обучающегося – 2,8	Программа высшего образования – программа бакалавриата	Практические, семинарские занятия	
		36 час.	28 час.
		Лабораторные занятия	
		- час.	- час.
		Самостоятельная работа	
		50,7 час.	57,8 час.
		Индивидуальные задания*	
		2 ТМК	2 ТМК
		Форма промежуточной аттестации	
		Экзамен (2,4 час.)	Экзамен (2,4 час.)

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 3 ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

для очно-заочной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 3 ТМК), при наличии - курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:

для очной формы обучения – 54/50,7

для очно-заочной формы обучения – 46/57,8

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: формирование теоретических знаний и практических навыков у обучающихся в сфере осуществления банковских инвестиций.

Задачи учебной дисциплины: изучение экономического содержания и особенностей инвестиций в банках, их источников и форм осуществления, правовых норм, регламентирующей инвестиционную банковскую деятельность, методики оценки инвестиционной привлекательности проектов, методов управления инвестициями в банках.

3. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.05 «Инвестиции в банках» относится к части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

Связь с другими дисциплинами учебного плана:

- перечень действующих и предшествующих дисциплин: «Математический анализ», «Макроэкономика», «Микроэкономика», «Экономика предприятия», «Деньги, кредит, банки», «Финансы».

- перечень теоретических дисциплин и практик, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: «Банковская экспертиза инвестиционных проектов», «Банковские риски и методики их измерения», «Банковские продукты и услуги», «Организация деятельности банка».

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

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

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
УК-2. Способен определять круг задач в рамках поставленной целии выбирать оптимальные способыих решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	ИДК-1 _{УК-2} Формулирует проблему, решение которой напрямую связано с достижением цели проекта. ИДК-2 _{УК-2} Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения. ИДК-3 _{УК-2} В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы.
УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	ИДК-2 _{УК-10} Применяет методы планирования для достижения текущих и долгосрочных экономических и финансовых целей, использует финансовые инструменты и методы экономических расчётов для обоснования и принятия хозяйственных решений в различных областях жизнедеятельности, управляет финансовыми ресурсами и контролирует собственныеэкономические риски. ИДК-3 _{УК-10} Обосновывает экономические решения по сферам жизнедеятельности.
ПК-10. Способен осуществлять разработку инвестиционного проекта	ИДК-1 _{ПК-10} Готовит предложения по инвестиционным проектам ИДК-2 _{ПК-10} Осуществляет бюджетирование инвестиционного проекта ИДК-3 _{ПК-10} Оценивает эффективность инвестиционного проекта, рассчитывает срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах ИДК-4 _{ПК-10} Разрабатывает финансовую модель и

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
	производственный план, прогнозирует доходы и расходы по инвестиционному проекту ИДК-5 _{пк-10} Оценивает устойчивость проекта к изменению условий внутренней и внешней среды, риски проекта

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: источники профессиональной информации в области инвестиционных операций банка; методы и инструменты инвестиционного менеджмента в банках; модели организации инвестиционной деятельности банков; тенденции развития инвестиционной сферы, а также инвестиционных операций банков; основные социально-экономические показатели, характеризующие рынок инвестиций, а также факторы, влияющие на него; стратегии и инструменты инвестиционного менеджмента; критерии социально-экономической эффективности инвестиций.

уметь: готовить предложения по инвестиционным проектам; оценивать эффективность инвестиционного проекта, рассчитывать срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах; прогнозировать доходы и расходы по инвестиционному проекту; оценивать устойчивость проекта к изменению условий внутренней и внешней среды, риски проекта; обосновывать выбор стратегии и инструментов в области осуществления банковских инвестиций.

владеть: методиками оценки эффективности инвестиционного проекта, определения срока окупаемости и потребности в кредитных ресурсах; навыками принятия управленческих решений в области банковских инвестиций; навыками технического и фундаментального анализа, принятия решений в области банковских инвестиций.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. ИНВЕСТИЦИИ В БАНКАХ

Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков

Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков. Экономическая сущность и формы инвестиций.

Тема 2. Инвестиционная политика банков. Инвестиционный процесс и механизм инвестиционного рынка.

Тема 3. Инвестиционная деятельность коммерческих банков на рынке ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков

Тема 4. Инвестиционно-проектное банковское финансирование.

Тема 5. Инвестиционный менеджмент в области финансовых активов.

Тема 6. Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в условиях динамичной экономической среды.

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Название смысловых модулей и тем	Количество часов												
	очная форма обучения						очно-заочная форма обучения						
	всего	в том числе					всего	в том числе					
		л ¹	п ²	лаб ³	инд ⁴	СР ⁵		л ¹	п ²	лаб ³	инд ⁴	СР ⁵	
<i>1</i>	<i>2</i>	<i>3</i>	<i>4</i>	<i>5</i>	<i>6</i>	<i>7</i>	<i>8</i>	<i>9</i>	<i>10</i>	<i>11</i>	<i>12</i>	<i>13</i>	
МОДУЛЬ 1. ИНВЕСТИЦИИ В БАНКАХ													
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков													
Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков. Экономическая сущность и формы инвестиций	12	2	6	-	-	4	11	2	4	-	-	5	
Тема 2. Инвестиционная политика банков. Инвестиционный процесс и механизм инвестиционного рынка	15	4	6	-	-	5	13	4	4	-	-	5	
Тема 3. Инвестиционная деятельность коммерческих банков на рынке ценных бумаг.	14	4	6	-	-	4	14	4	5	-	-	5	
Итого по смысловому модулю 1	41	10	18	-	-	13	38	10	13	-	-	15	
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков													
Тема 4. Инвестиционно- проектное банковское финансирование	12	2	6	-	-	4	13	2	5	-	-	6	
Тема 5. Инвестиционный менеджмент в области финансовых активов	15	4	6	-	-	5	15	4	5	-	-	6	
Тема 6. Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в условиях динамичной	12,1	2	6	-	-	4,1	13,8	2	5	-	-	6,8	

Название смысловых модулей и тем	Количество часов												
	очная форма обучения						очно-заочная форма обучения						
	всего	в том числе					всего	в том числе					
		л ¹	п ²	лаб ³	инд ⁴	СР ⁵		л ¹	п ²	лаб ³	инд ⁴	СР ⁵	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	
экономической среды													
Итого по смысловому модулю 2	39,1	8	18	-	-	13,1	41,8	8	15	-	-	18,8	
Всего по смысловым модулям	80,1	18	36	-	-	26,1	79,8	18	28	-	-	33,8	
Катт	0,9				0,9		1,8				1,8		
СРэк	24,6					24,6	24					24	
ИК													
КЭ	2				2		2				2		
Каттэк	0,4				0,4		0,4				0,4		
Контроль													
Всего часов	108	18	36	-	3,3	50,7	108	18	28	-	4,2	57,8	

Примечания: 1. л – лекции; 2. п – практические (семинарские) занятия; 3. лаб – лабораторные занятия; 4. инд – индивидуальные задания; 5. СР – самостоятельная работа.

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно-заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков			
1	Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков. Экономическая сущность и формы инвестиций	6	4
2	Тема 2. Инвестиционная политика банков. Инвестиционный процесс и механизм инвестиционного рынка	6	4
3	Тема 3. Инвестиционная деятельность коммерческих банков на рынке ценных бумаг.	6	5
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков			
4	Тема 4. Инвестиционно-проектное банковское финансирование	6	5
5	Тема 5. Инвестиционный менеджмент в области финансовых активов	6	5
6	Тема 6. Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в условиях динамичной экономической среды	6	5
ВСЕГО		36	28

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно- заочная форма

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	очно- заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков			
1	Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков. Экономическая сущность и формы инвестиций	4	5
2	Тема 2. Инвестиционная политика банков. Инвестиционный процесс и механизм инвестиционного рынка	5	5
3	Тема 3. Инвестиционная деятельность коммерческих банков на рынке ценных бумаг.	4	5
Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков			
4	Тема 4. Инвестиционно-проектное банковское финансирование	4	6
5	Тема 5. Инвестиционный менеджмент в области финансовых активов	5	6
6	Тема 6. Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в условиях динамичной экономической среды	4,1	6,8
ВСЕГО		26,1	33,8

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 проводится 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 проводится 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. Экономическая сущность и функции инвестиций.
3. Виды инвестиций.
4. Основные этапы инвестиционного процесса.
5. Содержание инвестиционной деятельности, субъекты и объекты.
6. Участники инвестиционной деятельности и их функции.
7. Источники финансирования инвестиционной деятельности, их преимущества и недостатки.
8. Инвестиционный рынок, его функции и структура.
9. Элементы инвестиционной политики банков.
10. Факторы, определяющие инвестиционную политику банков.
11. Активные операции банков на рынке ценных бумаг.
12. Пассивные операции банков на рынке ценных бумаг.
13. Профессиональная деятельность банков на рынке ценных бумаг.
14. Американская и германская модель инвестиционной деятельности банков на рынке ценных бумаг.
15. Собственный портфель ценных бумаг банка: назначение и функции.
16. Виды портфелей ценных бумаг банка.
17. Процесс управления собственным портфелем ценных бумаг банка.
18. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг банка.
19. Виды инвестиционных портфелей банков.
20. Доходность портфеля ценных бумаг, методы оценки.
21. Измерение риска инвестиционного портфеля ценных бумаг.
22. Принципы и методы управления портфелем ценных бумаг.
23. Теорема Г. Марковица, модель Г. Марковица и их использование при формировании портфелей ценных бумаг.
24. Диверсификация в портфельном инвестировании.
25. Систематический и несистематический риск, понятие рыночного и оптимального портфеля.
26. Основные положения модели У. Шарпа.
27. Активное и пассивное управление инвестиционным портфелем ценных бумаг.
28. Процедуры управления ликвидностью.

29. Понятие инвестиционного проекта, жизненный цикл инвестиционного проекта и его фазы.
30. Классификация инвестиционных проектов.
31. Показатели оценки инвестиционных проектов
32. Бизнес-план инвестиционного проекта, его содержание и структура.
33. Инвестиционное банковское кредитование и его отличия от проектного кредитования и проектного финансирования.
34. Объекты, субъекты банковского инвестиционного кредитования.
35. Классификация инвестиционных банковских кредитов.
36. Основные этапы процесса инвестиционного кредитования.
37. Экономическое содержание и специфика синдицированного кредитования.
38. Содержание и этапы предоставления ипотечного кредита на инвестиционные цели.
39. Содержание проектного финансирования и его участники.
40. Виды проектного финансирования в зависимости от источника средств.
41. Типы проектного финансирования.
42. Риски банков при реализации проектного финансирования.
43. Амортизация и прибыль как источники финансирования инвестиций в банке.
44. Формирование уставного капитала банка путем выпуска акций как источник инвестирования.
45. Депозитные и сберегательные сертификаты как инструменты банковского инвестирования.
46. Финансовый лизинг как форма кредитно-инвестиционной деятельности банка.
47. Банковский инвестиционный менеджмент на рынке ценных бумаг: особенности, цели, функции и задачи.
48. Основные этапы инвестиционного менеджмента на рынке ценных бумаг.
49. Разработка инвестиционной политики банка на рынке ценных бумаг.
50. Банк России на рынке ценных бумаг как регулятор, кредитор, эмитент ценных бумаг, инвестор.
51. Инвестиционный климат и факторы, которые на него влияют.
52. Понятие инвестиционного риска, виды банковских инвестиционных рисков.
53. Методы анализа банковских инвестиционных рисков.
54. Методы оценки рисков инвестиционных проектов, применяемые в банковской практике.
55. Диверсификация активов банка и обеспечение как способы снижения инвестиционного риска.
56. Влияние ресурсной базы банка на инвестиционный риск.
57. Специфика деятельности инвестиционных банков.
58. Услуги, виды деятельности и источники доходов инвестиционных банков.
59. Венчурный бизнес и андеррайтинг в банковской инвестиционной деятельности.
60. Проектирование и создание финансовых групп на базе банка.

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

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

Система оценивания по учебной дисциплине, изучаемой в очной форме обучения*

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1,2,3,4,5,6)	2	12
- тестирование (темы 1,2,3,4,5,6)	2	12
- разноуровневые задачи и задания (темы 2,3,4,5,6)	2	10
- контрольная работа (ТМК 1)	3	3
- контрольная работа (ТМК 2)	3	3
Промежуточная аттестация	<i>Экзамен</i>	<i>60</i>
Итого за семестр		100

* В соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине, изучаемой в очно-заочной форме обучения*

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль:		
- собеседование (темы 1,2,3,4,5,6)	2	12
- тестирование (темы 1,2,3,4,5,6)	2	12
- разноуровневые задачи и задания (темы 2,3,4,5,6)	2	10
- контрольная работа (ТМК 1)	3	3
- контрольная работа (ТМК 2)	3	3
Промежуточная аттестация	<i>Экзамен</i>	60
Итого за семестр	100	

* В соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Экономическая сущность и функции инвестиций.
3. Классификация инвестиций.
4. Содержание инвестиционного процесса и его основные этапы.
5. Содержание инвестиционной деятельности, субъекты и объекты, участники.
6. Источники финансирования инвестиционной деятельности, их преимущества и недостатки.
7. Инвестиционный рынок, его функции и структура.
9. Понятие инвестиционной политики банков и ее элементы.
10. Факторы, определяющие инвестиционную политику банков.
11. Операции банков на рынке ценных бумаг.
12. Американская и германская модель инвестиционной деятельности банков на рынке ценных бумаг.
13. Портфель ценных бумаг банка: назначение и функции.
14. Виды портфелей ценных бумаг банка.
15. Процесс управления собственным портфелем ценных бумаг банка и его основные этапы.
16. Принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг банка.
17. Виды инвестиционных портфелей банков.
18. Оценка доходности портфеля ценных бумаг банка.
19. Оценка риска инвестиционного портфеля ценных бумаг.
20. Принципы и методы управления портфелем ценных бумаг.
21. Формирование портфелей ценных бумаг, теорема Г. Марковица, модель Г. Марковица.
22. Диверсификация в портфельном инвестировании.
23. Понятия систематического и несистематического рисков, рыночного и оптимального портфеля.
24. Основные положения модели У. Шарпа.
25. Активное и пассивное управление инвестиционным портфелем ценных бумаг.
26. Управление ликвидностью инвестиционного портфеля ценных бумаг.
27. Понятие инвестиционного проекта, его жизненный цикл и фазы.
28. Классификация инвестиционных проектов.
29. Показатели оценки инвестиционных проектов
30. Бизнес-план инвестиционного проекта, его содержание и структура.
31. Инвестиционное банковское кредитование: особенности, объекты, субъекты, основные этапы.
32. Классификация инвестиционных банковских кредитов.
33. Особенности синдицированного кредитования.
34. Содержание и основные этапы ипотечного кредитования на инвестиционные цели.
35. Проектное финансирование: содержание, участники, виды и типы.
36. Риски банков при реализации проектного финансирования.
37. Источники финансирования инвестиций в банке: амортизация, прибыль, формирование уставного капитала банка путем выпуска акций.

38. Депозитные и сберегательные сертификаты как инструменты банковского инвестирования.
39. Финансовый лизинг как форма кредитно–инвестиционной деятельности банка.
40. Банковский инвестиционный менеджмент на рынке ценных бумаг: особенности, цели, функции и задачи.
41. Основные этапы инвестиционного менеджмента на рынке ценных бумаг: разработка инвестиционной политики, анализ инвестиционных качеств ценных бумаг, формирование инвестиционного портфеля, корректировка инвестиционного портфеля и оценка его результативности
42. Роль Банка России на рынке ценных бумаг как регулятора, кредитора, эмитента ценных бумаг, индивидуального и институционального инвестора.
43. Понятие инвестиционного климата, факторы, которые на него влияют.
44. Понятие инвестиционного риска, виды банковских инвестиционных рисков.
45. Методы анализа банковских инвестиционных рисков.
46. Методы оценки рисков инвестиционных проектов, применяемые в банковской практике.
47. Диверсификация активов банка и обеспечение как способы снижения инвестиционного риска.
48. Влияние ресурсной базы банка на инвестиционный риск.
49. Инвестиционные банки: специфика и виды деятельности, услуги, источники ресурсов и доходов.
50. Венчурный бизнес и андеррайтинг в банковской инвестиционной деятельности.
51. Проектирование и создание финансовых групп на базе банка.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу						Сумма, балл
Смысловой модуль 1			Смысловой модуль № 2			
19			21			40
T1	T2	T3	T4	T5	T6	
5	7	7	7	7	7	

Примечание. T1, T2, ... T6 – номера тем соответствующих смысловых модулей

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

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале	Определение
90-100	5 «отлично»	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
75-89	4 «хорошо»	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок
60-74	3 «удовлетворительно»	удовлетворительно – неплохо, но со значительным количеством недостатков
менее 60	2 «неудовлетворительно»	удовлетворительное выполнение со значительным количеством недостатков

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Соколинская, Н. Э., Инвестиционная банковская деятельность. : учебник / Н. Э. Соколинская, М. Х. Халилова, А. Ю. Михайлов. — Москва : КноРус, 2021. — 266 с. — ISBN 978-5-406-08577-6. — URL: <https://book.ru/book/940181> (дата обращения: 09.01.2024). — Текст : электронный.

Дополнительная литература::

1. Управление инвестиционной деятельностью : учебное пособие / составители С. А. Баркалов, В. П. Морозов, Т. А. Свиридова. — Москва : Ай Пи Ар Медиа, 2021. — 250 с. — ISBN 978-5-4497-1112-0. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/108295.html> (дата обращения: 09.01.2024). — Режим доступа: для авторизир. пользователей.

Учебно-методические издания:

1. Макухина, Я.О. Инвестиции в банках [Текст] : конспект лекций по учебной дисциплине для обучающихся направления подготовки 38.03.01 Экономика, профиль Банковское дело / Учебно-методический комплекс дисциплины.- Донецк : ДонНУЭТ, 2023.

2. Макухина, Я.О. Инвестиции в банках [Текст] : средства диагностики знаний для обучающихся направления подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Банковское дело» / Учебно-методический комплекс дисциплины.- Донецк : ДонНУЭТ, 2023 .

3. Макухина, Я.О. Инвестиции в банках [Текст] : методические рекомендации для проведения практических и семинарских занятий для обучающихся направления подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Банковское дело» / Учебно-методический комплекс дисциплины.- Донецк : ДонНУЭТ, 2023 .

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, сор. 2011–2024. — URL:<https://e.lanbook.com/> — Режим доступа: для авторизированных пользователей. — Текст : электронный.

6. СЭБ : Консорциум сетевых электронных библиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. — Санкт-Петербург : Лань, сор. 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, сор. 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, сор. 2017 –. – URL:<https://bookonline.ru>. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.

9. Информо : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информо», 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 авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический университет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008–. – URL:<http://liber.rea.ru/login.php>. – Режим доступа: для авторизованных 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 авторизованных 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 авторизованных пользователей. – Текст : электронный.

14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, сор. 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 ОПОП бакалавриата перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры банковского дела (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчество	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее - договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании ¹
Грицак Елена Владимировна	По основному месту работы	Должность - доцент, кандидат экономических наук, ученое звание - доцент	Высшее, электрические станции, инженер-электрик, диплом кандидата наук КД № 071517	1. Удостоверение о ПК №612400025326, 10.09.2022, «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое, психолого-педагогическое и методическое сопровождение», 24 ч. ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону. 2. Удостоверение о ПК №612400036359, 08.09.2023 «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлению подготовки Экономика и управление», 36 ч., ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону.

Примечание. За последние 3 года.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.05 «ИНВЕСТИЦИИ В БАНКАХ»

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль: Банковское дело

Трудоемкость учебной дисциплины: 3 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: источники профессиональной информации в области инвестиционных операций банка; методы и инструменты инвестиционного менеджмента в банках; модели организации инвестиционной деятельности банков; тенденции развития инвестиционной сферы, а также инвестиционных операций банков; основные социально-экономические показатели, характеризующие рынок инвестиций, а также факторы, влияющие на него; стратегии и инструменты инвестиционного менеджмента; критерии социально-экономической эффективности инвестиций.

уметь: готовить предложения по инвестиционным проектам; оценивать эффективность инвестиционного проекта, рассчитывать срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах; прогнозировать доходы и расходы по инвестиционному проекту; оценивать устойчивость проекта к изменению условий внутренней и внешней среды, риски проекта; обосновывать выбор стратегии и инструментов в области осуществления банковских инвестиций.

владеть: методиками оценки эффективности инвестиционного проекта, определения срока окупаемости и потребности в кредитных ресурсах; навыками принятия управленческих решений в области банковских инвестиций; навыками технического и фундаментального анализа, принятия решений в области банковских инвестиций.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
УК-2. Способен определять круг задач в рамках поставленной цели выбирать оптимальные способы решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	ИДК-1 _{УК-2} Формулирует проблему, решение которой напрямую связано с достижением цели проекта. ИДК-2 _{УК-2} Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения. ИДК-3 _{УК-2} В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы.
УК-10. Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	ИДК-2 _{УК-10} Применяет методы планирования для достижения текущих и долгосрочных экономических и финансовых целей, использует финансовые инструменты и методы экономических расчётов для обоснования и принятия хозяйственных решений в различных областях жизнедеятельности, управляет финансовыми ресурсами и контролирует собственные экономические риски. ИДК-3 _{УК-10} Обосновывает экономические решения по сферам жизнедеятельности.
ПК-10. Способен осуществлять разработку инвестиционного проекта	ИДК-1 _{ПК-10} Готовит предложения по инвестиционным проектам ИДК-2 _{ПК-10} Осуществляет бюджетирование инвестиционного проекта ИДК-3 _{ПК-10} Оценивает эффективность инвестиционного проекта, рассчитывает срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах ИДК-4 _{ПК-10} Разрабатывает финансовую модель и

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
	производственный план, прогнозирует доходы и расходы по инвестиционному проекту ИДК-5 _{ПК-10} Оценивает устойчивость проекта к изменению условий внутренней и внешней среды, риски проекта

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Теоретические и институциональные основы инвестиционной деятельности банков. Тема 1. Теоретические основы инвестиционной деятельности банков. Экономическая сущность и формы инвестиций. Тема 2. Инвестиционная политика банков. Инвестиционный процесс и механизм инвестиционного рынка. Тема 3. Инвестиционная деятельность коммерческих банков на рынке ценных бумаг.

Смысловой модуль 2. Практические аспекты инвестиционной деятельности банков. Тема 4. Инвестиционно-проектное банковское финансирование. Тема 5. Инвестиционный менеджмент в области финансовых активов. Тема 6. Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в условиях динамичной экономической среды.

Форма промежуточной аттестации: экзамен

Разработчик:

Грицак Е.В., кандидат экономических наук, доцент

Заведующий кафедрой банковского дела

Попова И.В., доктор экономических наук, доцент



(подпись)




(подпись)