

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт управления и территориального развития



УТВЕРЖДАЮ

Проректор
по образовательной деятельности КФУ
Проф. Минзарипов Р.Г.

_____ 20__ г.

Программа дисциплины

Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании М2.ДВ.2

Направление подготовки: 080500.68 - Бизнес-информатика

Профиль подготовки: Аналитика в управлении бизнесом

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Мельник А.Н.

Рецензент(ы):

Садриев А.Р.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Мельник А. Н.

Протокол заседания кафедры No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института управления и территориального развития:

Протокол заседания УМК No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Регистрационный No

Казань
2014

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) заведующий кафедрой, д.н. (профессор) Мельник А.Н. кафедра инноваций и инвестиций отделение управления территориями , Alexander.Melnik@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины "Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании" является формирование у студентов прочных теоретических знаний и практических навыков для оценки технико-экономической реализуемости инвестиционных проектов, анализа последствий их реализации, а также для разработки инструментария инвестиционного проектирования.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " М2.ДВ.2 Профессиональный" основной образовательной программы 080500.68 Бизнес-информатика и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 1 курсе, 2 семестр.

Дисциплина "Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании" является логическим продолжением ряда курсов, изученных студентами ранее, таких как "Экономическая оценка инвестиций", "Микроэкономика", "Макроэкономика".

В результате освоения дисциплины "Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании" студенты смогут применить полученные теоретические и практические знания при написании магистерской диссертации.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК- 2 (общекультурные компетенции)	способен к самостоятельному освоению новых методов исследования, изменению научного и научно-производственного профиля своей профессиональной деятельности
ОК-5 (общекультурные компетенции)	способность к творческой адаптации к конкретным условиям выполняемых задач и их инновационным решениям
ПК-1 (профессиональные компетенции)	готовить аналитические материалы для оценки мероприятий и выработки стратегических решений в области ИКТ
ПК-4 (профессиональные компетенции)	разрабатывать стратегию развития архитектуры предприятия
ПК-5 (профессиональные компетенции)	планировать процессы управления жизненным циклом ИТ инфраструктуры предприятия и организовывать их исполнение

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- источники финансирования инвестиционной деятельности;
- методы оценки эффективности инвестиционных проектов и принципы отбора инвестиционных проектов для финансирования;
- методы снижения инвестиционного риска;

□- методы принятия инвестиционных решений в организации.

2. должен уметь:

- использовать методы оценки для определения эффективности инвестиционных проектов;
- оценивать риски инвестиционных проектов;
- обосновывать инвестиционные решения;
- анализировать состояние инвестиционного климата на уровне региона.

3. должен владеть:

- навыками структурирования и разработки инвестиционных проектов;
- инструментами оценки социальной и экономической эффективности и уровня риска инвестиционных проектов;
- методами продвижения инвестиционных проектов и отбора их для финансирования.

- использовать полученные теоретические знания на практике.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет зачетных(ые) единиц(ы) 144 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен во 2 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Инвестиционное проектирование как деятельность.	2	1-2	2	4	0	
2.	Тема 2. Инвестиционный проект и формирование его концепции.	2	3-5	2	4	0	
3.	Тема 3. Многомерные модели в инвестиционном проектировании.	2	6-8	4	4	0	реферат

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
4.	Тема 4. Стохастическое и оптимальное инвестиционное проектирование.	2	9-10	2	4	0	
5.	Тема 5. Критические точки, потоки и области.	2	11-13	2	4	0	
6.	Тема 6. Неопределенность и риск при принятии инвестиционных решений.	2	14-15	2	4	0	
7.	Тема 7. Учет инфляции в инвестиционном проектировании.	2	16	2	2	0	контрольная работа
8.	Тема 8. Инвестирование в ценные бумаги.	2	17	2	2	0	
9.	Тема 9. Информационные технологии в инвестиционной деятельности.	2	18	2	2	0	
	Тема . Итоговая форма контроля	2		0	0	0	экзамен
	Итого			20	30	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Инвестиционное проектирование как деятельность.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Структура инвестиционного проектирования. Составляющие инвестиционной деятельности. Синтез и анализ в инвестиционном проектировании. Рост ВВП в зависимости от роста инвестиций в основной капитал. Корпоративный рост. Инвестиционное взаимодействие в экономическом росте. Сущность и методология в инвестиционном проектировании. Характеристика инвестиционного процесса в России.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Основные формы финансирования инвестиционных проектов.

Тема 2. Инвестиционный проект и формирование его концепции.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Понятие инвестиционного цикла. Основные стадии инвестиционного цикла и их характеристика. Понятие инвестиционного проекта, его сущностные черты. Виды инвестиционных проектов и их классификация. Процедуры идентификации инвестиционного проекта. Понятие жизненного цикла инвестиционного проекта.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Влияние стадийности инвестиционного цикла на дифференциацию фаз жизненного цикла проекта. Теоретические основы разработки концепции инвестиционного проекта.

Тема 3. Многомерные модели в инвестиционном проектировании.

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Проблемы финансового анализа инвестиций. Цикл моделирования инвестиционного проекта. Моделирование в пространстве критериев эффективности. Критерии эффективности с учетом предела экономического роста. Необходимость многомерного дисконтирования. Вектор чистого дисконтированного дохода. Матричная внутренняя норма доходности. Вектор индексов рентабельности. Вектор сроков окупаемости. Векторная функция логистического роста (ВФЛР). Вектор логистического чистого дисконтированного дохода. Логистическая матрица внутренней доходности. NPV для двух инвестиционных проектов. IRR для двух инвестиционных проектов.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Проектирование инвестиционного взаимодействия.

Тема 4. Стохастическое и оптимальное инвестиционное проектирование.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Вероятностные критерии экономической эффективности. Условные вероятностные показатели эффективности. Первый статистический момент. Адаптация аналитиков. Цели и ограничения в инвестиционном проектировании. Свертка критериев оптимальности. Оптимизация деятельности аналитиков. Оптимизация инвестиционных портфелей.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Оптимизация инвестиционного портфеля для активов трех видов.

Тема 5. Критические точки, потоки и области.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Критический поток реальных денег. Динамическая точка безубыточности. Критическая область стоимостей капитала. Критические области по оценке. Критические доверительные области.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Анализ безубыточности для нескольких видов товаров.

Тема 6. Неопределенность и риск при принятии инвестиционных решений.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Понятие неопределенности и риска. Классификация неопределенности и рисков. Управление инвестиционными рисками. Методы анализа и оценка уровня инвестиционного риска. Учет рисков в процессе формирования исходной экономической информации. Учет рисков при обосновании рисковой премии. Учет рисков при анализе чувствительности проекта.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Сущность сценарного подхода при проведении экономических обоснований вложения инвестиций.

Тема 7. Учет инфляции в инвестиционном проектировании.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Прогноз годового темпа и индекса инфляции. Прогноз инфляции по методу сложных процентов. Прогноз инфляции по методу цепных индексов. Учет инфляции при обосновании денежных потоков проекта. Показатели, используемые для описания инфляции при расчетах эффективности. Схема отражения инфляции в расчетах эффективности. Отражение инфляции в норме дохода. Учет инфляции при оценке потоков. Влияние инфляции на эффективность проекта в целом.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Учет влияния инфляции на эффективность собственного капитала. Учет влияния инфляции на проекты, реализуемые с одновременным использованием нескольких валют.

Тема 8. Инвестирование в ценные бумаги.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Портфельное инвестирование. Ценные бумаги как объект инвестирования. Инвестиционные операции на основе доверительного размещения средств. Инвестиционные операции с облигациями внутреннего государственного валютного займа. Инвестиционная деятельность на рынке корпоративных ценных бумаг.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Методы инвестирования в ценные бумаги: шарп, марковиц, рыночная модель.

Тема 9. Информационные технологии в инвестиционной деятельности.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Поддержка перемещения инвестиционных ресурсов. Особенности и тенденции развития. Принципы построения информационных систем. Компьютерные программы по оценке экономической эффективности инвестиционных проектов. Безопасность и надежность технологий инвестиционной деятельности. Система Project Expert для бизнес-аналитики. Работа с системой на разных стадиях.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Разработка и реализация инвестиционного проекта. Построение модели компании и ее экономического окружения в рамках проекта ее развития.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
3.	Тема 3. Многомерные модели в инвестиционном проектировании.	2	6-8	подготовка к реферату	45	реферат
7.	Тема 7. Учет инфляции в инвестиционном проектировании.	2	16	подготовка к контрольной работе	49	контрольная работа
	Итого				94	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

В соответствии с требованиями ФГОС удельный вес занятий, проводимых в активных и интерактивных формах, составляет не менее 40% аудиторных занятий. Так, в процессе изучения дисциплины "Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании" студенты решают предлагаемые задачи, выступают со стендовыми докладами. До 50% лекционных и практических занятий проходят с использованием презентаций MS PowerPoint.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Инвестиционное проектирование как деятельность.

Тема 2. Инвестиционный проект и формирование его концепции.

Тема 3. Многомерные модели в инвестиционном проектировании.

реферат , примерные темы:

Реферат

Тема 4. Стохастическое и оптимальное инвестиционное проектирование.

Тема 5. Критические точки, потоки и области.

Тема 6. Неопределенность и риск при принятии инвестиционных решений.

Тема 7. Учет инфляции в инвестиционном проектировании.

контрольная работа , примерные вопросы:

Решение задач

Тема 8. Инвестирование в ценные бумаги.

Тема 9. Информационные технологии в инвестиционной деятельности.

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

Перечень вопросов к экзамену представлен в приложении 1.

7.1. Основная литература:

1. Экономическая оценка инвестиций: Учеб. пособие / Т.Н. Тимченко. - 2-е изд. - М.: ИЦ РИОР, 2010. - 61 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=221240>
2. Экономическая оценка инвестиций: Учеб. пособие / Л.Е. Басовский, Е.Н. Басовская. - М.: ИНФРА-М, 2012. - 241 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=305574>
3. Инвестиционный анализ. Подготовка и оценка инвестиций в реальные активы: Учебник для бакалавров / И.В. Липсиц, В.В. Коссов. - М.: ИНФРА-М, 2011. - 320 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=223773>
4. Инвестиции: системный анализ и управление [Электронный ресурс] / Под ред. К. В. Балдина. - 4-е изд. испр. - М.: Дашков и К, 2013. - 288 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=430344>
5. Эффективность реальных инвестиций: Учебное пособие / Н.П. Макаркин. - М.: ИНФРА-М, 2011. - 432 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=217062>
6. Инвестиции: учеб. пособие / В.Е. Леонтьев, В.В. Бочаров, Н.П. Радковская. - М.: Магистр: ИНФРА-М, 2010. - 416 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=198282>
7. Инвестиции: Учебник / И.Я. Лукасевич. - М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2011. - 413 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=201525>
8. Инвестиции: Учебник / Л.Л. Игонина. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Магистр, 2010. - 749 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=216130>
9. Экономический анализ: Учебное пособие / В.В. Панков, Н.А. Казакова. - М.: Магистр: ИНФРА-М, 2011. - 624 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=238158>
10. Инвестиции: Учебник / Л.Л. Игонина. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Магистр, 2011. - 749 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=262995>

7.2. Дополнительная литература:

1. Оценка эффективности инвестиционных проектов: Учеб. пособие / А.С. Волков, А.А. Марченко. - М.: ИЦ РИОР: ИНФРА-М, 2011. - 111 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=308418>
2. Экономический анализ реальных инвестиций: Учебник / И.В. Липсиц, В.В. Коссов. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Магистр, 2010. - 383 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=325014>
3. Инвестиции: Учебник / И.Я. Лукасевич. - М.: Вузовский учебник: НИЦ Инфра-М, 2013. - 413 с. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=390600>
4. Чеботарев, Н. Ф. Оценка стоимости предприятия (бизнеса) [Электронный ресурс] : Учебник для бакалавров / Н. Ф. Чеботарев. - 3-е изд. - М.: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К-", 2014. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=450877>
5. Матраева, Л. В. Прямые иностранные инвестиции в современной мировой экономике [Электронный ресурс] : Монография / Л. В. Матраева. - М.: Маркетинг, 2013. // <http://www.znanium.com/bookread.php?book=451008>

6. Управление инвестиционной деятельностью в регионах Российской Федерации: Монография / О.Ф. Быстров, В.Я. Поздняков и др.; Ин-т управ. и права. - М.: ИНФРА-М, 2010. - 358 с. // <http://www.znaniium.com/bookread.php?book=200496>

7.3. Интернет-ресурсы:

Официальный сайт журнала "Аудиторские ведомости" - <http://au-ved.ru>

Официальный сайт журнала "Менеджмент в России и за рубежом" - <http://www.mevriz.ru>

Официальный сайт журнала "Российский экономический журнал" - <http://lib.ieie.nsc.ru/Magazin/Rr5.htm>

Официальный сайт журнала "Российское предпринимательство" - http://creativeconomy.ru/mag_rp

Официальный сайт журнала "Секрет фирмы" - <http://www.kommersant.ru/sf>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Бизнес-аналитика в инвестиционном проектировании" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Проекционное оборудование, используемое для проведения презентаций.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 080500.68 "Бизнес-информатика" и магистерской программе Аналитика в управлении бизнесом .

Автор(ы):

Мельник А.Н. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Садриев А.Р. _____

"__" _____ 201__ г.