

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 01.02.2021 08:06:39

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Самарский государственный экономический университет»

Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.13 Инвестиционное планирование

Основная профессиональная образовательная программа Направление 38.03.01 Экономика программа "Рынок ценных бумаг"

Методический отдел УМУ

« 25 » 03 2020 г.

Научная библиотека СГЭУ

« 03 » 04 2020 г.

Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры Экономической теории  
(протокол № 8 от 16.03.2020г.)

Зав. кафедрой М.Е.Коновалова /М.Е.Коновалова/

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Самара 2020

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Инвестиционное планирование входит в вариативную часть блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Экономика организации, Технологические основы производства, Экология, Корпоративные информационные системы в экономике, Институциональная экономика, Информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности, Электронный документооборот

Последующие дисциплины по связям компетенций: Основы финансовой политики фирмы, Практикум по валютному рынку

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Инвестиционное планирование в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - способностью выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ПК-3	ПК3з1: принципы расчетов показателей экономических разделов планов работы организации	ПК3у1: производить необходимые для экономического планирования расчеты	ПК3в1: навыками производства расчетов для экономических разделов планов организации
	ПК3з2: основы представления результатов расчетов экономических показателей планов в соответствии с принятыми в организации стандартами	ПК3у2: обосновывать расчеты экономических разделов планов и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами	ПК3в2: навыками обоснования результатов расчетов и представления их в соответствии со стандартами работы организации

ПК-8 - способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ПК-8	ПК8з1: возможности современных технических средств и информационных технологий для решения	ПК8у1: выбирать технические и информационные средства, необходимые для решения	ПК8в1: навыками применения современных технических средств и информационных технологий для решения

	аналитических и исследовательских задач	аналитических и исследовательских задач	аналитических и исследовательских задач
	ПК8з2: принципы решения аналитических и исследовательских задач с помощью технических средств и информационных технологий	ПК8у2: решать аналитические и исследовательские задачи при помощи технических средств и информационных технологий	ПК8в2: методологией анализа процессов, явлений и объектов при помощи современных технических средств и информационных технологий

### 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

#### Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 6
Контактная работа, в том числе:	55.15/1.53
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	43.85/1.22
Промежуточная аттестация	9/0.25
Вид промежуточной аттестации:	
Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

#### заочная форма

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 7
Контактная работа, в том числе:	9.15/0.25
Занятия лекционного типа	4/0.11
Занятия семинарского типа	4/0.11
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	95.85/2.66
Промежуточная аттестация	3/0.08
Вид промежуточной аттестации:	
Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

### 4. Содержание дисциплины

#### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Инвестиционное планирование представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий

##### Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		

			<b>Практич. занятия</b>				<b>соотношении с результатами обучения по образовательной программе</b>	
1.	Портфельное инвестирование	9	18			21,925	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2, ПК8з1, ПК8з2, ПК8у1, ПК8у2, ПК8в1, ПК8в2	
2.	Управление портфелем	9	18			21,925	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2, ПК8з1, ПК8з2, ПК8у1, ПК8у2, ПК8в1, ПК8в2	
	Контроль	9						
	<b>Итого</b>	<b>18</b>	<b>36</b>	<b>0.15</b>	<b>1</b>	<b>43.85</b>		

#### заочная форма

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе	
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР			
			Практич. занятия					
1.	Портфельное инвестирование	2	2			47,925	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2, ПК8з1, ПК8з2, ПК8у1, ПК8у2, ПК8в1, ПК8в2	
2.	Управление портфелем	2	2			47,925	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2, ПК8з1, ПК8з2, ПК8у1, ПК8у2, ПК8в1, ПК8в2	
	Контроль	3						
	<b>Итого</b>	<b>4</b>	<b>4</b>	<b>0.15</b>	<b>1</b>	<b>95.85</b>		

#### 4.2 Содержание разделов и тем

##### 4.2.1 Контактная работа

###### Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Портфельное инвестирование	лекция	Основы знаний о портфельном инвестировании
		лекция	Ожидаемая доходность и риск портфеля

		лекция	Выбор рискованного портфеля
		лекция	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
2.	Управление портфелем	лекция	Стратегии в управлении портфелем
		лекция	Принятие решения в условиях риска и неопределенности
		лекция	Параметрическая модель VaR

\*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Портфельное инвестирование	практическое занятие	Основы знаний о портфельном инвестировании
		практическое занятие	Ожидаемая доходность и риск портфеля
		практическое занятие	Выбор рискованного портфеля
		практическое занятие	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
2.	Управление портфелем	практическое занятие	Стратегии в управлении портфелем
		практическое занятие	Принятие решения в условиях риска и неопределенности
		практическое занятие	Параметрическая модель VaR

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Портфельное инвестирование	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Управление портфелем	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

1. Теплова, Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 1 : учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 409 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01818-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/434189>

2. Теплова, Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 382 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01820-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/434190>

#### Дополнительная литература

1. Сергеев, А.А. Бизнес-планирование: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. А. Сергеев. — 3-е изд., испр. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2019. — 475 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-06299-1. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/434599>

2. Касьяненко, Т. Г. Инвестиционный анализ: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — Москва: Издательство Юрайт, 2019. — 560 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-9546-6. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/427134>

### 5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

### 5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### 5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

### 5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС

	СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

## 6. Фонд оценочных средств по дисциплине Инвестиционное планирование:

### 6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	-
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

### 6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

#### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - способностью выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами

Планируемые результаты	Планируемые результаты обучения по дисциплине
------------------------	-----------------------------------------------

обучения по программе			
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК3з1: принципы расчетов показателей экономических разделов планов работы организации	ПК3у1: производить необходимые для экономического планирования расчеты	ПК3в1: навыками производства расчетов для экономических разделов планов организации
Повышенный	ПК3з2: основы представления результатов расчетов экономических показателей планов в соответствии с принятыми в организации стандартами	ПК3у2: обосновывать расчеты экономических разделов планов и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами	ПК3в2: навыками обоснования результатов расчетов и представления их в соответствии со стандартами работы организации

ПК-8 - способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

Планируемые результаты обучения по программе	<b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК8з1: возможности современных технических средств и информационных технологий для решения аналитических и исследовательских задач	ПК8у1: выбирать технические и информационные средства, необходимые для решения аналитических и исследовательских задач	ПК8в1: навыками применения современных технических средств и информационных технологий для решения аналитических и исследовательских задач
Повышенный	ПК8з2: принципы решения аналитических и исследовательских задач с помощью технических средств и информационных технологий	ПК8у2: решать аналитические и исследовательские задачи при помощи технических средств и информационных технологий	ПК8в2: методологией анализа процессов, явлений и объектов при помощи современных технических средств и информационных технологий

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Портфельное инвестирование	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2, ПК8з1, ПК8з2, ПК8у1, ПК8у2, ПК8в1, ПК8в2	Оценка докладов Тестирование	Зачет
2.	Управление портфелем	ПК3з1, ПК3з2, ПК3у1, ПК3у2, ПК3в1, ПК3в2,	Оценка докладов Тестирование	Зачет

#### 6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

##### Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Портфельное инвестирование	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.Необходимость и сущность портфельного инвестирования.</li> <li>2.Общие принципы построения инвестиционных портфелей.</li> <li>3.Механизм портфельного инвестирования.</li> <li>4.Субъекты портфельного инвестирования.</li> <li>5.Объекты портфельного инвестирования.</li> <li>6.Правовое регулирование портфельного инвестирования.</li> <li>7.Регуляторы рынка портфельного инвестирования</li> </ol>
Управление портфелем	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.Пассивные и активные стратегии управления портфелем.</li> <li>2. Пассивные стратегии управления портфелем. Активные стратегии управления портфелем.</li> <li>3.Механические стратегии по размещению средств по классам активов.</li> <li>4.Стратегия постоянной пропорции между классами активов.</li> <li>5.Стратегия диапазона.</li> <li>6.Стратегии плавающей пропорции.</li> <li>7.Стратегии страхования портфеля.</li> </ol>

##### Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ, <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Какие функции выполняют финансы организаций?

- воспроизводственную, контрольную, распределительную
- контрольную, учетную
- распределительную, контрольную

Кто формирует финансовую политику организации?

- главный бухгалтер организации
- финансовый менеджер
- руководитель хозяйствующего субъекта

Основной целью финансового менеджмента является:

- разработка финансовой стратегии организации
- рост дивидендов организации
- максимизация рыночной стоимости организации

Объектами финансового менеджмента являются:

- финансовые ресурсы, внеоборотные активы, заработная плата основных работников
- рентабельность продукции, фондоотдача, ликвидность организации
- финансовые ресурсы, финансовые отношения, денежные потоки

Что является управляющей подсистемой финансового менеджмента?

- дирекция коммерческой организации
- финансовое подразделение и бухгалтерия
- маркетинговая служба организации

К основным концепциям финансового менеджмента относятся концепции:

- двойная запись
- компромисса между доходностью и риском
- делегирования полномочий

"Золотое правило" финансового менеджмента - это:

- рубль сегодня стоит больше, чем рубль – завтра
- доход возрастает по мере уменьшения риска
- чем выше платежеспособность, тем меньше ликвидность

Финансовый менеджмент представляет собой:

- государственное управление финансами
- управление финансовыми потоками коммерческого предприятия в рыночных условиях хозяйствования
- управление финансовыми потоками некоммерческого предприятия

Финансовая стратегия – это:

- определение долговременного курса в области финансов предприятия, направленного на решение крупномасштабных задач
- решение задач конкретного этапа развития финансов предприятия
- разработка новых форм и методов распределения денежных средств предприятия

Прогнозирование является основой:

- оперативного планирования
- текущего планирования
- перспективного планирования

Формирование учетной политики возлагается на:

- главного бухгалтера предприятия
- главного бухгалтера совместно с представителем юридического управления предприятия
- руководителя хозяйствующего субъекта

Какие стадии в производстве проходит промышленный капитал?

- денежную
- финансовую
- кредитную

К собственным средствам (капиталу) предприятия относятся:

- уставный капитал
- здание
- готовая продукция

К активам предприятия относятся:

- кредиторская задолженность
- краткосрочные банковские ссуды
- внеоборотные фонды

Равномерные платежи или поступления денежных средств через одинаковые интервалы времени при использовании одинаковой ставки процента – это:

- аннуитет
- дисконтирование
- своп

Если равномерные платежи предприятия производятся в конце периода, то такой поток называется:

- пренумерандо
- перпетуитет
- постнумерандо

Организация мобилизует свои денежные средства на:

- страховом рынке
- рынке коммуникационных услуг
- фондовом рынке

Организация привлекает краткосрочные ссуды на:

- страховом рынке
- денежном рынке

Из перечисленных источников информации к внутренним относится:

- уровень инфляции
- отчет о прибылях и убытках
- данные статистического сборника

Внешним пользователем информации являются:

- финансовый менеджер организации
- главный бухгалтер организации

Из перечисленных источников информации для финансового менеджера к внешним относятся:

- бухгалтерский баланс
- прогноз социально-экономического развития отрасли
- отчет о движении денежных средств

Какие средства из внешних источников может привлечь предприятие для финансирования капитальных вложений:

- амортизационные отчисления предприятия
- оборотные средства
- банковский кредит

Выручка от реализации продукции представляет собой:

- текущие затраты предприятия на производство реализованной продукции и капитальные вложения
- сумму денежных средств, фактически поступивших на расчетный счет и в кассу предприятия за вычетом НДС, акцизов и денежных накоплений
- сумму денежных средств от реализации продукции, работ и услуг по отпускным ценам, поступивших на расчетный счет и в кассу предприятия

**Практические задачи (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с электронным изданием, если имеется)**

Раздел дисциплины	Задачи

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

**Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета**

Раздел дисциплины	Вопросы
Портфельное инвестирование	1.Необходимость и сущность портфельного инвестирования. 2.Общие принципы построения инвестиционных портфелей. 3.Механизм портфельного инвестирования. 4.Субъекты портфельного инвестирования. 5.Объекты портфельного инвестирования. 6.Правовое регулирование портфельного инвестирования. 7.Регуляторы рынка портфельного инвестирования 8.Ожидаемая доходность актива. 9.Ожидаемый риск портфеля. 10. Риск портфеля, состоящего из нескольких активов. 11. Доминирующий портфель.

	<p>12. Эффективный набор портфелей.</p> <p>13. Портфель, состоящий из актива без риска и рискованного актива.</p> <p>14. кредитный и заемный портфели.</p> <p>15. Эффективная граница портфелей, состоящих из актива без риска и рискованного актива.</p> <p>16. Рыночный портфель.</p> <p>17. Модель оценки стоимости активов (САРМ).</p> <p>18. Модель У. Шарпа.</p> <p>19. Определение набора эффективных портфелей.</p> <p>20. Прогнозирование величины Бета.</p>
Управление портфелем	<p>21. Арбитражная модель Росса.</p> <p>22. Определение эффективной границы с помощью кривых изосредних и изодисперсий.</p> <p>23. Определение эффективной границы Марковица методом множителей Лагранжа.</p> <p>24. Определение рыночного портфеля при возможности заимствования и кредитования.</p> <p>25. Определение оптимального портфеля с помощью линейного программирования.</p> <p>26. Пассивные и активные стратегии управления портфелем.</p> <p>27. Пассивные стратегии управления портфелем. Активные стратегии управления портфелем.</p> <p>28. Механические стратегии по размещению средств по классам активов.</p> <p>29. Стратегия постоянной пропорции между классами активов.</p> <p>30. Стратегия диапазона.</p> <p>31. Стратегии плавающей пропорции.</p> <p>32. Стратегии страхования портфеля.</p> <p>33. Функции полезности инвестора.</p> <p>34. Концепция полезности и аксиомы рационального выбора.</p> <p>35. Премия за риск Марковица.</p> <p>36. Кривая безразличия.</p> <p>37. Выбор оптимального портфеля.</p> <p>38. Максимизация количества стандартных отклонений между доходностью портфеля и целевым уровнем.</p> <p>39. Инвестиционный выбор на основе принципа стохастического доминирования.</p> <p>40. Эффект выбора среднего портфеля.</p> <p>41. Абсолютный и относительный VaR.</p>

### 6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

#### Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	ПК3з1, ПК3у1, ПК3в1, ПК8з1, ПК8у1, ПК8в1
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне