

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: Врио ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 10.07.2023 15:48:11

Уникальный программный ключ:

b2fd765521f4c570b8c6e8e502a10b4f1de8ae0d

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

Институт Институт менеджмента

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.ДЭ.08.01 Практикум портфельное инвестирование

Основная профессиональная образовательная программа 38.03.05 Бизнес-информатика программа ИТ-Предпринимательство

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Самара 2023

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 Практикум портфельное инвестирование входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений (дисциплина по выбору) блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Социальные инновации и предпринимательство, Устойчивое развитие бизнеса, Процессно-ориентированное управление, Экономические методы оценки эффективности ИТ-проектов

Последующие дисциплины по связям компетенций: Бренд-менеджмент, Управление рисками, Проектирование стартапа (продвинутый уровень)

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

Изучение дисциплины Практикум портфельное инвестирование в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен обосновывать управленческие решения в профессиональной деятельности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:
	теоретические основы принятия управленческих решений в профессиональной деятельности, инструментарий бизнес – анализа, в том числе необходимые информационные технологии (программное обеспечение)	обосновывать управленческие решения на основе результатов бизнес – анализа, разрабатывать стратегию и тактику реализации управленческих решений, оценивать эффективность и последствия управленческих воздействий	навыками планирования и мониторинга исполнения управленческих решений, организации своевременной корректировки управленческих действий при изменении параметров внутренней и внешней среды на основе критериев оптимизации

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 7
Контактная работа, в том числе:	36.15/1
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	18/0.5
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	17.85/0.5
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации:	
Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	72

Зачетные единицы	2
------------------	---

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Практикум портфельное инвестирование 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 соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Основы знаний о портфельном инвестировании	9	9			9	ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
2.	Методы и модели в портфельном инвестировании	9	9			8,85	ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
	Контроль	18					
	Итого	18	18	0.15		17.85	

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.	Основы знаний о портфельном инвестировании	лекция	Необходимость и сущность портфельного инвестирования
		лекция	Общие принципы построения инвестиционных портфелей
		лекция	Правовое регулирование портфельного инвестирования
		лекция	Ожидаемая доходность и риск портфеля
2.	Методы и модели в портфельном инвестировании	лекция	Выбор рискованного портфеля
		лекция	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
		лекция	Стратегии управления портфелем
		лекция	Принятие решений 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	Вид занятия	Тематика занятия семинарского
------	-------------------	-------------	-------------------------------

	(раздела) дисциплины	семинарского типа**	типа
1.	Основы знаний о портфельном инвестировании	практическое занятие	Необходимость и сущность портфельного инвестирования
		практическое занятие	Общие принципы построения инвестиционных портфелей
		практическое занятие	Правовое регулирование портфельного инвестирования
		практическое занятие	Ожидаемая доходность и риск портфеля
2.	Методы и модели в портфельном инвестировании	практическое занятие	Выбор рискованного портфеля
		практическое занятие	Определение эффективной границы и оптимальных портфелей
		практическое занятие	Стратегии управления портфелем
		практическое занятие	Принятие решений 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.	Основы знаний о портфельном инвестировании	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Методы и модели в портфельном инвестировании	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

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

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 вузов / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 409 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01818-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512507>

2. Теплова, Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / Т. В. Теплова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 382 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01820-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512509>

Дополнительная литература

1. Касьяненко, Т. Г. Экономическая оценка инвестиций : учебник и практикум / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 559 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3089-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/508146>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. 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

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Практикум портфельное инвестирование:

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; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

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

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен обосновывать управленческие решения в профессиональной деятельности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	теоретические основы принятия управленческих решений в профессиональной деятельности, инструментальный бизнес – анализа, в том числе необходимые информационные технологии (программное обеспечение)	обосновывать управленческие решения на основе результатов бизнес – анализа, разрабатывать стратегию и тактику реализации управленческих решений, оценивать эффективность и последствия управленческих воздействий	навыками планирования и мониторинга исполнения управленческих решений, организации своевременной корректировки управленческих действий при изменении параметров внутренней и внешней среды на основе критериев оптимизации
Пороговый	теоретические основы	обосновывать	навыками планирования и

	принятия управленческих решений в профессиональной деятельности	управленческие решения на основе результатов бизнес – анализа	мониторинга исполнения управленческих решений
Стандартный (в дополнение к пороговому)	инструментарий бизнес – анализа	разрабатывать стратегию и тактику реализации управленческих решений	организации своевременной корректировки управленческих действий
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	инструментарий бизнес – анализа, в том числе необходимые информационные технологии (программное обеспечение)	оценивать эффективность и последствия управленческих воздействий	организации своевременной корректировки управленческих действий при изменении параметров внутренней и внешней среды на основе критериев оптимизации

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.	Основы знаний о портфельном инвестировании	ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3		
2.	Методы и модели в портфельном инвестировании	ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3		

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Основы знаний о портфельном инвестировании	<ol style="list-style-type: none"> 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. 12. Эффективный набор портфелей. 13. Портфель, состоящий из актива без риска и рискованного актива. <p>Кредитный и заемный портфели.</p>

Методы и модели в портфельном инвестировании	<ol style="list-style-type: none"> 1. Эффективная граница портфелей, состоящих из актива без риска и рискованного актива 2. Модель оценки стоимости активов (САРМ) 3. Определение набора эффективных портфелей 4. Определение эффективной границы с помощью кривых изосредних и изодисперсий 5. Определение эффективной границы Марковица методом множителей Лагранжа 6. Определение рыночного портфеля при возможности заимствования и кредитования 7. Определение оптимального портфеля с помощью линейного программирования 8. Стратегия постоянной пропорции между классами активов 9. Функции полезности инвестора 10. Премия за риск Марковица 11. Максимизация количества стандартных отклонений между доходностью портфеля и целевым уровнем 12. Абсолютный и относительный VaR 13. Ожидаемые потери портфеля в случае повышения значения VaR 14. Модель EaR
--	--

Задачи для аналитического исследования

Раздел дисциплины	Вопросы
Основы знаний о портфельном инвестировании	<p>Выбрать 10 финансовых активов, которые торгуются на Московской бирже и обосновать свой выбор.</p> <p>На сайте Московской биржи найти спецификации и информацию по ценам закрытия выбранных активов со 2 августа по 3 сентября 2021 года. На основе ежедневных доходностей активов двумя способами рассчитать характеристики портфелей: наивного, с максимальной доходностью и с минимальным риском. Далее рассчитать характеристики лучшего, с Вашей точки зрения, портфеля и обосновать выбор именно такого портфеля. Все расчеты сделать в Excel.</p>
Основы знаний о портфельном инвестировании	<p>Выбрать 10 финансовых активов, которые торгуются на Московской бирже и обосновать свой выбор.</p> <p>На сайте Московской биржи найти спецификации и информацию по ценам закрытия выбранных активов со 2 августа по 3 сентября 2021 года. На основе ежедневных доходностей активов двумя способами рассчитать характеристики портфелей: наивного, с максимальной доходностью и с минимальным риском. Далее рассчитать характеристики лучшего, с Вашей точки зрения, портфеля и обосновать выбор именно такого портфеля. Все расчеты сделать в Excel.</p>

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

Уровень инфляции представляет собой:

- показатель изменения денежной массы за период времени
- показатель темпа прироста ИПЦ за период времени
- показатель суммы обесцененных денег за период времени
- показатель увеличения стоимости денег вследствие начисления процентов

Индекс покупательной способности денег представляет собой:

- показатель, равный обратной величине индекса цен
- ставку доходности при инвестировании денежных средств
- показатель скорости документооборота
- показатель дисконтирования денежных сумм

Показатель денежного мультипликатора представляет собой

- компонент денежной массы, который характеризует величину денежных средств, поступивших в систему коммерческих банков
- коэффициент, который показывает во сколько раз денежная масса больше величины наличных денег в банковской системе
- запас денежной массы на 1 руб. валового внутреннего продукта
- форму существования государственного внутреннего долга

Рынок ценных бумаг – это:

- совокупность сделок, связанных с покупкой и продажей валюты
- совокупность сделок с ценными бумагами
- сделки с недвижимостью

Главная задача рынка ценных бумаг – это:

- привлечение капитала для политического развития
- удовлетворение общественных потребностей
- привлечение капитала для экономического развития

Организованный рынок ценных бумаг осуществляется

- государством
- биржей
- акциями
- облигациями

Укажите, какие финансовые инструменты считаются наиболее рискованными:

- опционы и фьючерсы
- акции
- облигации корпораций и предприятий нефинансового сектора экономики
- государственные облигации

При математическом учете применяется

- декурсивная ставка процента
- антисипативная ставка процента
- реальная ставка процента

Право, оформленное договором, купить, продать (или отказаться от сделки) на протяжении договорного срока и по фиксированной договорной цене определенный объем ценных бумаг либо получить определенный доход от финансового вложения или денежного займа – это

- опцион
- вексель
- фьючерсный контракт

Опцион, реализация которого не приносит прибыли, называется

- опционом «без денег»
- опционом «при своих»
- опционом «при деньгах»

Как называется цена исполнения опциона, цена, по которой можно купить или продать базисный актив опциона?

- спорт-цена
- страйк-цена
- фьючерсная цена

Какая статья свидетельствует о наличии «больной» статьи в отчетности

- векселя выданные просроченные
- кредиты банков сроком свыше 1 года
- кредиторская задолженность

О чем свидетельствует высокий удельный вес в отчетности такой статьи, как «Векселя полученные просроченные»:

- об определенных недостатках в работе организации
- о крайне неудовлетворительной работе организации
- ни о чем

Обыкновенная акция имеет рыночную стоимость 120 руб. Доход на акцию по итогам года составил 14 руб. Определите для акции коэффициент P/E:

- 8,34;
- 8,57;
- 11,15;
- 13,65.

Коэффициент P/E показывает:

- отношение темпов роста прибыли компании к рыночной цене акции
- отношение прибыли на акцию к рыночной цене акции
- отношение рыночной цены акции к темпам роста прибыли компании
- отношение рыночной цены акции к прибыли на акцию

Укажите, какое из следующих утверждений наиболее точно характеризует смысл показателя P/E:

- показатель прибыльности компании
- показатель нераспределенной прибыли в расчете на одну обыкновенную акцию
- количество лет при текущем уровне прибыли, которое потребуется компании для того, чтобы окупить цену своих акций
- показатель капитализации компании

Банк выплачивает 12% годовых. Проценты сложные. Какую минимальную сумму требуется разместить вкладчику в банке, чтобы через 2 года у него было не менее 10 000 руб.?

- 7972
- 5555
- 6354
- 8515

Номинал облигации 1 000 руб., купон 10%, выплачивается один раз в год. До погашения облигации 3 года. Определить цену облигации, если ее доходность до погашения должна составить 12%.

- 951,96
- 1000
- 1049,74

Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 18 000 руб., ставкой выплачиваемого ежегодно купонного дохода 12% и сроком погашения 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых.

- 17164
- 17296
- 17565
- 17706

Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 18 000 руб., ставкой выплачиваемого ежегодно купонного дохода 11% и сроком погашения 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 12% годовых.

- 17568
- 16857
- 17105
- 17800

Рассчитайте рыночную стоимость облигации номиналом 17 000 руб., ставкой выплачиваемого ежегодно купонного дохода 12% и сроком погашения 3 года, если ставка процента по вкладу в банке составляет 14% годовых.

- 16211
- 16105
- 16817
- 17421

Процесс увеличения суммы денег в результате присоединения процентов к сумме платежа называется:

- дисконтированием
- наращиванием
- присоединением

При сроке меньше одного года эффективнее ставка процента:

- простая
- сложная
- обе ставки дают равный результат

Контрольный пакет акций:

- 50% + 1 акция
- 100%
- 49% + 1 акция

В результате сглаживания временного ряда 6, 2, 7, 5, 12 простой трехчленной скользящей средней первое сглаженное значение равно

В результате сглаживания временного ряда 6, 2, 7, 5, 12, 15 простой трехчленной скользящей средней второе сглаженное значение равно: (до 0,1)

Акция может быть приобретена в данный момент за 1400 руб. Рассчитайте конечную доходность акции, если инвестор планирует продать ее через год по цене 1480 руб., а ожидаемая сумма дивидендов за год составляет 130 руб.

Чистая прибыль акционерного общества составила 1 000 000,00 руб. Акции этого общества (их выпущено 2000 шт.) продаются на рынке по 2 500 руб. за акцию. Рассчитайте показатель дохода на акцию (EPS)

Чистая прибыль акционерного общества составила 1 000 000,00 руб. Акции этого общества (их выпущено 2000 шт.) продаются на рынке по 2 500 руб. за акцию. Рассчитайте коэффициент (P/E)

ПК5в2. Вкладчик положил в банк 10 000 руб. Банк выплачивает сложные проценты. Какая сумма будет на счете у вкладчика через три года, если процентная ставка за первый год составляет 20%, за второй - 30%, за третий - 25%?

- 19500
- 20100
- 21000
- 24300

Вкладчик положил в банк некоторую сумму в начале 2009 г. Банк начислял с периодичностью раз в полгода простые проценты по следующим годовым процентным ставкам: 2009 г. - 90% от ставки рефинансирования Банка России; 2010 г. - 80% от ставки рефинансирования Банка России; 2011 г. - 70% от ставки рефинансирования Банка России. В предположении, что вкладчик не снимал денег со своего счета, определите, какую сумму он положил в банк, если на его счете в середине 2010 г. было 28 600 руб. Для ставки Банка России принять следующие значения: 2009 г. - 12%; 2010 г. - 9%; 2011 г. - 8%.

- 22700

-24237
-25000
-23337

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Основы знаний о портфельном инвестировании	<ol style="list-style-type: none">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 инвестирования8. Ожидаемая доходность актива.9. Ожидаемый риск портфеля.10. Риск портфеля, состоящего из нескольких активов.11. Доминирующий портфель.12. Эффективный набор портфелей.13. Портфель, состоящий из актива без риска и рискованного актива.14. Кредитный и заемный портфели.15. Эффективная граница портфелей, состоящих из актива без риска и рискованного актива.16. Рыночный портфель.
Методы и модели в портфельном инвестировании	<ol style="list-style-type: none">17. Модель оценки стоимости активов (САРМ).18. Модель У. Шарпа.19. Определение набора эффективных портфелей.20. Прогнозирование величины Бета.21. Арбитражная модель Росса.22. Определение эффективной границы с помощью кривых изосредних изодисперсий.23. Определение эффективной границы Марковица методом множителей Лагранжа.24. Определение рыночного портфеля при возможности заимствования и кредитования.25. Определение оптимального портфеля с помощью линейного программирования.26. Пассивные и активные стратегии управления портфелем.27. Пассивные стратегии управления портфелем. Активные стратегии управления портфелем.28. Механические стратегии по размещению средств по классам активов.29. Стратегия постоянной пропорции между классами активов.30. Стратегия диапазона.31. Стратегии плавающей пропорции.32. Стратегии страхования портфеля.33. Функции полезности инвестора.

	<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> <p>42. Оценка ошибки параметрической модели.</p> <p>43. Ожидаемые потери портфеля в случае повышения значения VaR.</p> <p>44. Модель EaR.</p> <p>45. Историческое моделирование.</p> <p>46. Оценка VaR с помощью метода Монте-Карло.</p> <p>47. Выбор метода оценки VaR.</p> <p>48. Стресс-тестирование.</p> <p>49. Отображение финансовых активов с помощью стандартных факторов риска.</p> <p>50. Дельта- VaR, компонент VaR и VaR- Бета.</p> <p>51. Оценка доходности и риска.</p> <p>52. Определение доходности методом оценки стоимости единицы капитала</p> <p>53. Показатели эффективности управления портфелем.</p> <p>54. Индекс Модильяни.</p> <p>55. Учет асимметрии и эксцесса.</p> <p>56. Коэффициент Сортино.</p> <p>57. Показатели способности менеджера прогнозировать доходности активов и конъюнктуру.</p> <p>58. Омега.</p> <p>59. Разложение доходности на составляющие компоненты.</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»	ПК-2
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне