Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Агафонов Александр Викторович
Должность: директор филиала
Дата подписания: 20.06.2025 19:28:49
Уникальный программный ключ:
2539477a8ecf706dc9cff164bc411eb6d3c4ab06

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«МОСКОВСКИЙ ПОЛИТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
ЧЕБОКСАРСКИЙ ИНСТИТУТ (ФИЛИАЛ) МОСКОВСКОГО ПОЛИТЕХНИЧЕСКОГО УНИВЕРСИТЕТА

Кафедра «Менеджмент и экономика»

УТВЕРЖДАЮ
Директор филиала
_____________ А.В. Агафонов
«30» мая 2025г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Портфельное инвестирование»

(наименование дисциплины)

Направление подготовки	**38.04.02 «Менеджмент»** (код и наименование направления подготовки)
Направленность (профиль) подготовки	**«Корпоративное управление»** (наименование профиля подготовки)
Квалификация выпускника	**магистр**
Форма обучения	**заочная**
Год начала обучения	**2025**

Чебоксары, 2025

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент.

Рабочая программа дисциплины включает в себя оценочные материалы для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине (п.8 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины)

Авторы: Стуканова Софья Сергеевна, доктор экономических наук, профессор кафедры «Менеджмент и экономика»;

Программа одобрена на заседании кафедры «Менеджмент и экономика» (протокол № 8 от 12.04.2025г).

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы (Цели освоения дисциплины)

1.1. Целями освоения дисциплины «Портфельное инвестирование» являются: формирование у студентов знаний о сущности и содержании портфельного инвестирования, методов управления инвестиционными проектами и оценки привлекательности инвестиционных проектов для компании.

1.2. Области профессиональной деятельности и(или) сферы профессиональной деятельности, в которых выпускники, освоившие программу, могут осуществлять профессиональную деятельность:
08 Финансы и экономика (в сферах: внутреннего и внешнего финансового контроля и аудита; финансового консультирования)

1.3. К основным задачам изучения дисциплины относится подготовка обучающихся к выполнению трудовых функций в соответствии с профессиональными стандартами:

Наименование профессиональных стандартов (ПС)	**Код, наименование и уровень квалификации ОТФ, на которые ориентирована дисциплина**	**Код и наименование трудовых функций, на которые ориентирована дисциплина**
08.037 Профессиональный стандарт «Бизнес-аналитик», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 25.09.2018 №592н (зарегистрирован в Минюсте Российской Федерации 11.10.2018 №52408)	E - Управление бизнес-анализом - 7	E/01.7 - Обоснование подходов, используемых в бизнес-анализе
		E/07.2 - Руководство бизнес-анализом
	F - Аналитическое обеспечение разработки стратегии изменений организации - 7	F/01.7 - Определение направлений развития организации
		F/02.7 - Разработка стратегии управления изменениями в организации
08.043 Профессиональный стандарт «Экономист предприятия», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 30.03.2021 №161н (зарегистрирован в Минюсте Российской Федерации 29.04.2021 №63289)	B - Планирование и прогнозирование экономической деятельности организации -7	B/01.7 - Подготовка экономических обоснований для стратегических и оперативных планов развития организации
		B/02.7 - Стратегическое управление ключевыми экономическими показателями и бизнес-процессами

1.4. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Перечень планируемых результатов обучения
Разработка и реализация проектов	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами.	Знать: этапы жизненного цикла проекта; особенности разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. Уметь: разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла. Владеть: методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла.
		УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах)	Знать: особенности разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла; инструменты планирования целевых этапов жизненного цикла проекта. Уметь: анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта. Владеть: методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах).

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Перечень планируемых результатов обучения
		УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	Знать: методики разработки и управления проектом; методы оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта. Уметь: определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта. Владеть: методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.
профессиональные	ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления;	Знать: предметную область и специфику деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточном для решения задач бизнеса; современную методологию управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления. Уметь: применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные концепции социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; Владеть: навыками внесения совершенствований в системы корпоративного управления на основе применения современных методологий и стандартов управления проектами и программами.
		ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного	Знать: принципы и методы разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренние (внешние)

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Перечень планируемых результатов обучения
		управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса;	факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации). Уметь: разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации). Владеть: навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса.
		ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	Знать: виды и методы принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса. Уметь: определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса Владеть: навыками управления изменениями в части внесения корректировок в

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенций	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Перечень планируемых результатов обучения
			управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Портфельное инвестирование» реализуется в рамках в рамках части, формируемой участниками образовательных отношений (вариативной части) Блока 1, элективные дисциплины (модули) «Дисциплины (модули)» программы магистратуры

Дисциплина базируется на курсах дисциплин, входящих в модули дисциплин: Психология управления и саморазвития, Управленческая экономика, Теория и практика корпоративного управления, Принятие управленческих решений в корпорациях, Иностранный язык и межкультурная коммуникация, Управление изменениями в корпорациях и является залогом успешного освоения производственная практика: научно-исследовательская работа; производственная практика: практика по профилю профессиональной деятельности; производственная практика: преддипломная практика, Государственная итоговая аттестация: подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы.

3. Объем дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы (144 академических часов), в том числе:

заочная форма обучения:

Семестр	4
лекции	4
лабораторные занятия	-
семинары и практические занятия	6
контроль: контактная работа	0,3
контроль: самостоятельная работа	35,7
расчетно-графические работы, курсовые работы (проекты): контактная работа	-
расчетно-графические работы, курсовые работы (проекты): самостоятельная работа	-
консультации	1
Контактная работа	11,3
Самостоятельная работа	132,7

Вид промежуточной аттестации (форма контроля): экзамен

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам)

Заочная форма обучения

Тема (раздел)	Количество часов				Код индикатора достижений компетенции
	контактная работа			самостоятельная работа	
	лекции	лабораторные занятия	семинары и практические занятия		
Портфельное инвестирование: концептуальная схема, основные подходы, классы субъектов и объектов	0,5	-	1	17	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Введение в робоэдвайзинг	0,5	-	1	20	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Анализ успешности управления и атрибуция доходности управления активами	1	-	1	20	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Портфельные алгоритмы	1		1	20	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Информационные наборы и портфели	1		2	20	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Консультации	1			-	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
Контроль (экзамен)	0,3			35,7	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
ИТОГО	**11,3**			**132,7**	

5. Образовательные технологии, применяемые при освоении дисциплины

Методика преподавания дисциплины и реализация компетентностного подхода в изложении и восприятии материала предусматривает использование следующих форм проведения групповых, индивидуальных, аудиторных занятий в сочетании с внеаудиторной работой с целью формирования и развития профессиональных навыков обучающихся: лекционные, практические и лабораторные занятия.

При проведении учебных занятий обеспечивается развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств, включая интерактивные лекции, групповые дискуссии, ролевые игры, анализ ситуаций и имитационных

моделей, преподавание дисциплины в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых институтом, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей.

Пример интерактивных форм и методов проведения занятий:

Пример кейса:

Бандрика - небольшая страна, затерянная среди трансильванских гор, известная остальному миру как лидер в области исследований и образования в сфере голдберг-машинного обучения (Goldberg machine learning, GML), ультрасовременной научной дисциплины, использующей силу повседневных вещей для выполнения сложных вычислительных задач. Rube Cube Endowment создан пять лет назад благородными семьями страны с конечной целью предоставлять гранты местному сообществу исследователей GML. Инфляция бандрийского талера составляла в среднем 2,5% за последние 5 лет. GML - это быстро растущий исследовательский фронт, и поэтому иностранные исследователи предъявляют чрезвычайные требования к оборудованию, произведенному исключительно в Бандрике. Предполагается, что цены на оборудование в номинальном выражении вырастут на 5% в год в течение следующих 5 лет. Согласно бандрийскому закону, чтобы сохранить освобождение от налогов, фонд должен ежегодно тратить не менее 3% от СЧА, установленного в начале года. В прошлом году Rube Cube Endowment распределил 3 000 000 талеров среди исследователей GML – что безопасно далеко от порога в 3%, учитывая его СЧА; в то время как спонсоры ожидают примерно того же (или более высокого) вложения в этом году, они признают, что текущие распределения должны позволять некоторый рост основного капитала (примерно 2% в реальном выражении), поскольку они не собираются предоставлять значительные подарки в ближайший срок. Плата за управление активами составляет 1% от СЧА в начале года.

Рассчитайте требования к правилам минимального расхода для фонда.

	Начало предыдущего года	Начало текущего года
СЧА	30000000	75000000
Облигации	30%	?
Акции	60%	?
Товары	5%	?
Валюты	5%	?

6. Практическая подготовка

Практическая подготовка реализуется путем проведения практических занятий, предусматривающих участие обучающихся в выполнении отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью. Объем занятий в форме практической подготовки 6 часов по заочной форме обучения.

заочная форма обучения

Вид занятия	Тема занятия	Количество часов	Форма проведения	Код индикатора достижений компетенции
ПЗ	Портфельное инвестирование: концептуальная схема, основные подходы, классы субъектов и объектов	1	Разбор кейса	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
ПЗ	Введение в робоэдвайзинг	1	Разбор кейса	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
ПЗ	Анализ успешности управления и атрибуция доходности управления активами	1	Разбор кейса	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
ПЗ	Портфельные алгоритмы	1	Разбор кейса	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3
ПЗ	Информационные наборы и портфели	2	Разбор кейса	УК-2.1., УК-2.2., УК-2.3. ПК-3.1., ПК-3.2., ПК-3.3

7. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Самостоятельная работа студентов предусмотрена учебным планом по дисциплине в объеме 132,7 часов по заочной форме обучения. Самостоятельная работа реализуется в рамках программы освоения дисциплины в следующих формах:

- работа с учебной литературой;
- решение типовых задач;
- разбор вопросов по теме занятия;
- выполнение домашних заданий;
- подготовка к контрольной работе.

8. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

8.1. Паспорт фонда оценочных средств

№	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код и наименование компетенции	Индикатор достижения компетенции	Наименование оценочного средства
1.	Портфельное инвестирование: концептуальная схема, основные подходы, классы субъектов и объектов	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и	Опрос, тест, реферат

			основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	
		ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений	

			относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	
2.	Введение в робоэдвайзинг	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	Опрос, тест, реферат
		ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных	

			сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	
3.	Анализ успешности управления и атрибуция доходности управления активами	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	Опрос, тест, реферат
		ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной	

		концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	
4.	Портфельные алгоритмы	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план	Опрос, тест, реферат

			реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	
		ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	
5.	Информационные наборы и портфели	УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами.	Опрос, тест, реферат

			УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	
		ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и	

			программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	

Этапы формирования компетенций в процессе освоения ОПОП прямо связаны с местом дисциплин в образовательной программе. Каждый этап формирования компетенции характеризуется определенными знаниями, умениями и навыками и (или) опытом профессиональной деятельности, которые оцениваются в процессе текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по дисциплине (практике) и в процессе государственной итоговой аттестации: подготовки к процедуре защиты и защиты выпускной квалификационной работы.

Дисциплина «Портфельное инвестирование» является начальным этапом комплекса дисциплин, в ходе изучения которых у студентов формируются компетенции УК-2, ПК-3.

Формирование указанных компетенций продолжается в ходе прохождения обучающимися производственной практики: практики по профилю профессиональной деятельности, производственной практики: преддипломной практики.

Завершается работа по формированию у студентов указанных компетенций в ходе подготовки к прохождению государственной итоговой аттестации: подготовки к процедуре защиты и защиты выпускной квалификационной работы.

Итоговая оценка сформированности компетенций УК-2, ПК-3 определяется в период государственной итоговой аттестации: подготовки к процедуре защиты и защиты выпускной квалификационной работы.

В процессе изучения дисциплины, компетенции также формируются поэтапно.

Основными этапами формирования УК-2, ПК-3 при изучении дисциплины «Портфельное инвестирование» является последовательное изучение содержательно связанных между собой тем учебных занятий. Для оценки уровня сформированности компетенций в процессе изучения дисциплины предусмотрено проведение текущего контроля успеваемости по темам (разделам) дисциплины и промежуточной аттестации по дисциплине – экзамена.

8.2. Контрольные задания и материалы, необходимые для оценки знаний, умений и навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих

этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

8.2.1. Контрольные вопросы по темам (разделам) для опроса на занятиях

Тема (раздел)	Вопросы
Портфельное инвестирование: концептуальная схема, основные подходы, классы субъектов и объектов	1. Стратегии портфельного инвестирования 2. Система разделения труда в инвестиционной индустрии 3. Инструменты инвестирования и факторные модели 4.В чем состоит экономический смысл портфельного инвестирования? 5.Что такое инвестиционный портфель? 6.Виды ценных бумаг и их инвестиционные качества 7. Перечислите основные и локальные цели портфельного инвестирования. 8. Преимущества инвестора, формирующего инвестиционный портфель, по сравнению с моноинвестированием. 9.Основные принципы формирования инвестиционного портфеля. 10.Виды инвестиционных портфелей
Формирование и управление инвестиционным портфелем	1. Перечислите основные этапы формирования портфеля ценных бумаг 2.Основные инвестиционные параметры финансовых инструментов 3.Формирование инвестиционного портфеля по критериям доходности, риска и ликвидности 4. Управление портфелем финансовых инвестиций 5.Виды стратегий и подсгратегий управления портфелем финансовых активов 6.Факторы, определяющие выбор той или иной стратегии управления портфелем 7. Наиболее эффективные инвестиционные стратегии на российском фондовом рынке 8.Специфические черты, присущие портфелю реальных инвестиционных проектов 9.Основные этапы формирования портфеля реальных инвестиционных проектов 10.Оптимизация инвестиционных решений в условиях дефицита средств финансирования
Анализ успешности управления и атрибуция доходности управления активами	1. Анализ успешности управления инвестиционным портфелем 2. Реализация пассивного управления инвестиционным портфелем 3.Реализация активного управления инвестиционным портфелем 4.Особенности активного инвестиционного портфеля 5.Особенности пассивного инвестиционного портфеля 6.Особенности умеренного инвестиционного портфеля 7.Оценка эффективности портфельных инвестиций 8.Инструменты оценки эффективности портфельного инвестирования 9.Инструменты для анализа рисков и доходности портфеля инвестиций 10.Основные принципы формирования эффективного инвестиционного портфеля
Портфельные алгоритмы	1. Основные стратегии управления инвестиционным портфелем 2.Основные стратегии реализации пассивного управления

	инвестиционным портфелем 3. Портфель ценных бумаг: цели, задачи, принципы формирования. 4. Понятие оптимального портфеля и способы его построения 5. Выбор подхода к диверсификации портфеля. 6.Особенности и методика формирования портфеля роста 7. Особенности и методика формирования портфеля с оптимальным уровнем риска 8. Особенности и методика формирования портфеля с максимальным уровнем доходности 9. Назовите принципы формирования портфеля из облигаций. 10. Назовите стратегии инвесторов при формировании портфелей из опционов.
Информационные наборы и портфели	1.Фондовый индекс и его роль в оценки параметров инвестиционных портфелей. 2. Методика расчета стоимости и доходность привилегированных и обыкновенных акций 3. Методика расчета стоимости, текущая доходности и доходности на момент погашения облигации 4.Российский фондовый рынок: виды обращающихся ценных бумаг 5. Фондовые индексы как индикаторы состояния финансового рынка 6. Понятия систематические и несистематические риски и их виды 7.Понятия безрисковая и среднерыночная ставка доходности финансовых активов 8.Основные факторы, учитываемые при формировании инвестиционного портфеля 9.Оптимизация риска и доходности при инвестировании в портфель 10.Понятие и учет бета-коэффициента при формировании инвестиционного портфеля

Шкала оценивания ответов на вопросы

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«Отлично»	Обучающийся глубоко и содержательно раскрывает ответ на каждый теоретический вопрос, не допустив ошибок. Ответ носит развернутый и исчерпывающий характер.
«Хорошо»	Обучающийся в целом раскрывает теоретические вопросы, однако ответ хотя бы на один из них не носит развернутого и исчерпывающего характера.
«Удовлетворительно»	Обучающийся в целом раскрывает теоретические вопросы и допускает ряд неточностей, фрагментарно раскрывает содержание теоретических вопросов или их раскрывает содержательно, но допуская значительные неточности.
«Неудовлетворительно»	Обучающийся не знает ответов на поставленные теоретические вопросы.

8.2.2. Темы для рефератов (докладов), самостоятельной работы студентов

1. Фундаментальный закон инвестирования.
2. Основные коэффициенты для анализа успешности управления
3. Анализ успешности управления с использованием альтернативных мер

риска и с учетом высших моментов в доходностях.
4. Анализ успешности управления с использованием информации о структуре портфеля
5. Анализ успешности управления с использованием информации об исторической доходности
6. Факторные модели в анализе успешности управления
7. Атрибуция доходности в Bloomberg.
8. Анализ устойчивости результатов управления по методу Шарпа.
9. Оболочечный анализ успешности управления.
10. Бэктесты портфельных алгоритмов.
11. Ситуационное профилирование клиента.
12. Психологическое профилирование клиента.
13. Система разделения труда в робоэдвайзинге и робоэдвайзинг в системе
14. Бизнес-модели классических игроков инвестиционной отрасли.
15. Бизнес-модели новых игроков инвестиционной отрасли.
16. Учет фундаментального закона инвестирования при анализе успешности управления
17. Методы анализа успешности управления
18. Методы профилирования клиента.
19. Методы бэктеста портфельных алгоритмов.
20. Активное портфельное инвестирование на международных рынках.
21. Активные стратегии эксплуатирующие поведенческие отклонения и стилизованные факты о финансовых временных рядах.
22. Стратегии хеджевых фондов.
23. Управление «альфой».
24. Стратегии скрининга акций и «smart beta».
25. Методы пассивного инвестирования.
26. Полуактивное инвестирование, понятие и роль information ratio в нем.
27. Использование факторных моделей в полуактивном инвестировании (tilted allocation и alpha/beta separation). Подход core-satellite.
28. Простейшие неоптимизационные алгоритмы аллокации: 60/40, экспертный, взвешивание по объемам; по волатильности.
29. Методы повышения устойчивости портфельного управления.
30. Метод аллокации по Блэку-Литтерману.

Шкала оценивания

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«Отлично»	Обучающийся глубоко и содержательно раскрывает тему самостоятельной работы, не допустив ошибок. Ответ носит развернутый и исчерпывающий характер.
«Хорошо»	Обучающийся в целом раскрывает тему самостоятельной работы, однако ответ хотя бы на один из них не носит развернутого и исчерпывающего характера.
«Удовлетворительно»	Обучающийся в целом раскрывает тему самостоятельной работы и допускает ряд неточностей, фрагментарно

	раскрывает содержание теоретических вопросов или их раскрывает содержательно, но допуская значительные неточности.
«Неудовлетворительно»	Обучающийся не владеет выбранной темой самостоятельной работы

8.2.3. Оценочные средства остаточных знаний (тест)

УК-2

1. Инвестиционный портфель, формируемый по критерию максимизации текущего дохода или прироста инвестируемого капитала вне зависимости от сопутствующего им уровня инвестиционного риска, считается ... портфелем

а) агрессивным;

б) умеренным;

в) консервативным.

г)полным

2. Инвестиционный портфель, уровень риска по которому приближен к среднерыночному и доходность приближена к среднерыночной, считается ... портфелем

а) консервативным;

б) агрессивным;

в) умеренным.

г) доходным

3. В модели Марковица для оценки инвестором эффективности вложения денег в портфель акций используются:

а) ожидаемая доходность и темп инфляции;

б) ковариация и коэффициент корреляции доходности акций портфеля;

в) дисперсия доходности акций портфеля и темп инфляции;

г) ожидаемая доходность и дисперсия доходности акций портфеля.

4. Основным преимуществом формирования портфеля ценных бумаг служит:

а) возможность освободиться от уплаты налогов;

б) низкий риск инвестирования;

в) возможность получения желаемого результата за короткий промежуток времени;

г) возможность быстрого вложения денег в инвестиционные объекты.

5. Если инвестор сформировал «портфель роста», то:

а) он рассчитывает на рост курсовой стоимости ценных бумаг;

б) его надежды связаны с ростом ВВП;

в) он рассчитывает на рост количества ценных бумаг в портфеле;

г) его стратегия связана с ожидаемым ростом темпов инфляции.

6. Если инвестор сформировал портфель из государственных облигаций с целью получения стабильного высокого дохода, то по склонности к риску такого инвестора можно отнести к ... типу:

а) агрессивному;

б) умерено-агрессивному;

в) консервативному;

г) нейтральному.

7. Сопоставление величины исходной инвестиции с общей суммой дисконтированных денежных поступлений, генерируемых ею в течение прогнозируемого срока позволяет определить показатель:

а) DPP;

б) IRR;

в) NPV;

г) PI.

8. Верно ли утверждение, что оптимальный портфель обязательно должен быть эффективным?

а) да;

б) нет, в определенных условиях инвестор может в качестве оптимального выбирать и неэффективный портфель;

в) это зависит от отношения конкретного инвестора к риску;

г) нет, при высоких уровнях корреляции это условие может не выполняться.

9.Уравнение линейной регрессии в модели У.Шарпа связывает:

а) дисперсии случайных ошибок акций портфеля;

б) доходности конкретной акции портфеля и доходности рыночного портфеля;

в) доходности рыночного портфеля и дисперсию доходностей рыночного портфеля;

г) ожидаемую доходность портфеля и дисперсию портфеля.

10. Пассивное управление портфелем ценных бумаг представляет собой:

а) управление через посредника;

б) создание портфеля на длительную перспективу;

в) создание портфеля на краткосрочных ценных бумаг;

г) создание портфеля акций.

11. В модели ценообразования на капитальные активы (CAPM) коэффициент бэта характеризует …

а) неустойчивость (изменчивость) дохода отдельной ценной бумаги относительно доходности рыночного портфеля;

б) устойчивость дохода отдельной ценной бумаги относительно

доходности рыночного портфеля.

в)меру систематического риска

г)меру несистематического риска)

12. В общем случае процесс формирования портфеля ценных бумаг …

а)не относится к инвестированию, так как приобретение ценных бумаг вообще нельзя считать инвестированием

б)относится к инвестированию, но только если портфель создается на срок свыше 1 года

в)относится к инвестированию, но только если портфель содержит свыше 51 % акций предприятия

г)относится к инвестированию, поскольку в этом случае инвестор имеет обычную для инвестирования цель – получение прибыли (дохода) от вложенных денег

13. Преимуществом портфельного инвестирования является …

а)быстрая окупаемость высоких первоначальных затрат

б)возможность разграничения инвестиционных качеств конкретной ценной бумаги

в)получение ожидаемой доходности при минимальном риске

г)получение ожидаемой доходности при низком риске

14) Преимуществом портфельного инвестирования является …

а)быстрая окупаемость высоких первоначальных затрат

б)возможность разграничения инвестиционных качеств конкретной ценной бумаги

в)получение ожидаемой доходности при минимальном риске

г)получение ожидаемой доходности при низком риске

15. Если инвестор сформировал «портфель роста», то …

а) его надежды связаны с ростом ВВП

б) его стратегия связана с ожидаемым ростом темпов инфляции

в) он рассчитывает на рост количества ценных бумаг в портфеле

г) он рассчитывает на рост курсовой стоимости ценных бумаг портфеля

16. Что понимается под рынком капиталов (capital market)?

17. Что относится к заёмным средствам предприятия при реализации инвестиционных проектов?

18. Что понимается под проектным финансированием инвестиций?

19. Что понимается под купонным доходом инвестора?

20. С какой целью используется Бета-коэффициент?

21. Что включает в себя понятие «управление портфелем ценных бумаг»?

22. Почему приобретение облигации является инвестицией?

23.Назовите цели диверсификация портфеля ценных бумаг?

24. Что означает консервативный тип инвестиций?

25.Что понимается под мониторингом эмитента?

26. Что такое портфельное инвестирование ?

27.Как портфельное инвестирование отличается от инвестирования в отдельные активы?

27.Какие преимущества связаны с портфельным инвестированием?

28.Какие риски связаны с портфельным инвестированием?

29.Какие виды портфельных инвестиций существуют?

30.Чем виды портфельных инвестиций отличаются друг от друга?

31.Какие факторы необходимо учитывать при формировании портфеля инвестиций?

32.Какие инструменты используются для оценки эффективности портфельного инвестирования?

33.Какие методы используются для оценки эффективности портфельного инвестирования?

34.Как связаны риск и доходность при портфельном инвестировании?

35.Какие требования относятся к диверсификации при портфельном инвестировании?

36.Какие роли играют активно управляемые портфели в портфельном инвестировании?

37.Какие роли играют пассивные портфели в портфельном инвестировании?

38.Какие проблемы стоят перед портфельным инвестированием в настоящее время?

39.Какие перспективы развития портфельного инвестирования представляются в будущем?

40. Каким образом портфельные инвестиции влияют на диверсификацию инвестиционного портфеля и снижение рисков?

41.Какие проблемы возникают при инвестировании в портфель и как они могут быть решены?

42. Каким образом портфельные инвестиции влияют на формирование личного финансового плана и достижение финансовых целей?

43. Какие виды портфельных инвестиций существуют?

44. Как виды портфельных инвестиций отличаются друг от друга?

45. Каким образом портфельные инвестиции влияют на инвестиционный риск ?

46.Каким образом портфельные инвестиции влияют на доходность компании ?

47. Какие инвестиционные стратегии можно использовать для управления рисками?

48. Какие тенденции и направления развития портфельных инвестиций можно выделить на ближайшую перспективу?

49.Какие возможности развития и проблемы могут принести портфельные инвестиции?

50.Что такое портфельные инвестиции и как они отличаются от других видов инвестирования?

51.Какие преимущества предоставляют портфельные инвестиции в сравнении с инвестированием в отдельные активы?

52.Каким образом происходит формирование портфеля инвестиций ?

53.Какие факторы влияют на выбор определенных активов при формировании портфеля?

54.Какие инструменты используются для анализа рисков и доходности портфеля инвестиций?

55.Каким образом портфельные инвестиции влияют на экономическое развитие страны?

56.Какие факторы учитываются при инвестировании в портфель?

57.Какие стратегии можно использовать для управления инвестиционным портфелем?

58.Какие альтернативные стратегии инвестирования можно использовать вместо портфельных инвестиций?

59.Каковы основные принципы формирования эффективного инвестиционного портфеля?

60.Как определить оптимальный баланс между риском и доходностью при инвестировании в портфель?

61.Основные виды стратегии портфельного инвестирования

62. Принципы формирования инвестиционного портфеля

63.Отличительные особенности портфелей реальных и финансовых инвестиций.

64.Методы снижения инвестиционного риска

65.Инвестиционные качества основных финансовых инструментов

66.Методы оценки эффективности портфельных инвестиций

67.Меторды диверсификации инвестиционного портфеля

68. Инструменты и методика анализа рисков и доходности портфеля инвестиций

69.Основные управленческие стратегии по работе с портфельными инвестициями

70. Основные индикаторы состояния финансового рынка

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
а	в	г	в	а	в	в	а	б	б	в	г	б	б	г

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Критерии оценивания сформированности компетенции (части компетенции)
УК-2.1. Знать: этапы жизненного цикла проекта; этапы разработки и реализации проекта; методы разработки и управления проектами. УК-2.2. Уметь: разрабатывать проект с учетом	выполнение 70% и более оценочных средств по определению уровня достижения результатов обучения по дисциплине

анализа альтернативных вариантов его реализации, определять с использованием инструментов планирования целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла, осуществлять мониторинг хода его реализации, вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; представлять публично результаты проекта (его этапов) в различной форме (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах) УК-2.3. Владеть: методиками разработки и управления проектом; методами оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта	

ПК-3

1. ***Для заданного количества ценных бумаг портфеля найти такую их комбинацию, чтобы риск получился минимально возможным***

а) можно, и существует единственная подобная комбинация,

б) можно, и таких комбинаций существует бесконечно много,

в) нельзя, так как это противоречит теореме о границе эффективных портфелей,

г) нельзя, поскольку риск распадается на систематический и несистематический

2.Общественно значимый проект иметь отрицательную общественную эффективность

а) не может теоретически,

б) может,

в) может, если бюджетная эффективность проекта окажется отрицательной,

г) может, что зависит от количества шагов расчета.

3.К портфельным иностранным инвестициям относятся:

а) Вложения капитала, взятого на определенных условиях в любом иностранном банке

б) Предложения от иностранных инвесторов в виде портфеля документов, т. е. предполагающие несколько направлений инвестирования

в) Вложения в иностранные ценные бумаги, цель которого заключается в «игре» на курсах валют с целью получения прибыли

г)Вложения иностранных инвесторов

4.Инвестиционный риск региона определяется:

а) Вероятностью потери инвестиций или дохода от них

б) Количеством вариантов возможного инвестирования

в) Наличием у региона полезных ископаемых, стратегически важных объектов, дотациями правительства

г) Отсутствием трудовых ресурсов

5. Среди методов государственного воздействия на инвестиционную деятельность можно выделить:

а) Основные и дополнительные

б) Прямые и косвенные

в) Административные и экономические

г) Юридические и организационные

6. В международно-правовой практике используется следующая классификация инвесторов:

а) Эмитенты ценных бумаг, национальные инвесторы, иностранные инвесторы

б) Эмитенты ценных бумаг, индивидуальные инвесторы, институциональные инвесторы

в) Национальные инвесторы, иностранные инвесторы

г) Нет правильного ответа

7. Имущественные и неимущественные права инвестора на рынке ценных бумаг закрепляются:

а) Ценной бумагой

б) Соглашением

в) Инвестиционным договором

г) В Федеральном законе "О рынке ценных бумаг" от 22.04.1996 N 39-ФЗ

8. По возможности изменения объема инвестированных ресурсов различают виды портфелей:

а) бессрочный

б) непополняемый

в) отзываемый

г) консервативный

9. Снизить инвестиционный риск позволяет:

а) диспансеризация

б) дисперсия

в) диверсификация

г) диверсия

10. Коэффициент бета измеряет ... риск

а) политический

б) недиверсифицируемый
в) экологический
г) допустимый

11. Если инвестор сформировал портфель из государственных облигаций с целью получения стабильного дохода, то по склонности к риску такого инвестора, скорее всего, можно отнести к … типу

а)консервативному
б)агрессивному
в)нейтральному
г)умеренно-агрессивному

12. К ценным бумагам с фиксированным доходом можно отнести …

а)привилегированную акцию
б)государственную облигацию, привилегированную акцию и опцион эмитента
в)опцион эмитента
г)государственную облигацию

13. Объектом инвестирования в реальные средства может быть …

а)предмет антиквариата
б)квалификация сотрудника фирмы
в)вексель промышленной компании
г)земельный участок

14. ... это акционер компании (физическое или юридическое лицо), размер пакета акций которого не позволяет ему напрямую участвовать в управлении компанией

а)Спекулянт
б)Мажоритарий
в)Миноритарий
г)Инвестор

15. Если инвестор сформировал «портфель роста», то …

а)его надежды связаны с ростом ВВП
б)его стратегия связана с ожидаемым ростом темпов инфляции
в)он рассчитывает на рост количества ценных бумаг в портфеле
г)он рассчитывает на рост курсовой стоимости ценных бумаг портфеля

16. Что представляет собой портфель ценных бумаг?
17. Назовите виды рисков, которые существуют для портфельных инвестиций?
18. Что понимается под систематическим риском (рыночным риском)?
19. Что входит в состав несистематических рисков?
20. Назовите факторы сбалансированности инвестиционного портфеля?

21. Назовите основных участников фондового рынка?

22. Что предполагает активное управление инвестиционным портфелем?

23. Что понимается под пассивным управлением инвестиционным портфелем?

24. Что представляют собой финансовые инвестиции?

25. Как выбрать подходящие активы для включения в инвестиционный портфель?

26. Что следует понимать под инвестиционным климатом?

27.Какие виды рисков могут возникнуть при инвестировании в портфель и как их можно снизить?

28.Каким образом инвестиции в различные активы могут влиять на доходность и риск портфеля?

29.Какие стратегии портфельного инвестирования могут быть использованы для управления доходностью?

30.Каким образом портфельные инвестиции могут быть использованы для достижения долгосрочных финансовых целей?

31.Каким образом выбор долгосрочных и краткосрочных инвестиционных стратегий может влиять на доходность и риск портфеля?

32.Каким образом рост или снижение процентных ставок может повлиять на портфельные инвестиции?

33.Каким образом инфляция может повлиять на доходность и риск портфеля?

34.Каким образом изменения в экономической и политической обстановке могут повлиять на портфельные инвестиции?

35.Каким образом международные инвестиции могут быть использованы для диверсификации портфеля?

36.Каким образом инвестиции в различные сектора экономики могут влиять на риск и доходность портфеля?

37.Как отличить диверсифицируемые и недиверсифицируемые риски?

38. Какие существуют основные способы диверсификации портфеля?

39. Какова корреляция ценных бумаг и риск портфеля?

40. Понятие оптимального портфеля и способы его построения.

41. Бета (β-коэффициент) корпорации.

42. Факторы, влияющие на β –коэффициент.

43. Недооцененные и переоцененные ценные бумаги.

44. Формирование портфеля ценных бумаг.

45. Пассивное и активное управление инвестиционным портфелем.

46. Оценка эффективности управления портфелем ценных бумаг

47. Издержки управления портфелем.

48. Выбор инвестиционной политики инвестиционным менеджером

49. Оценка эффективного портфеля.

50. Расчет средневзвешенной цены капитала

51. Критерии выбора вложений капитала.

52. Оптимальный бюджет капиталовложений.

53.Макроэкономические факторы и их влияние на разные типы

инвестиционных активов.

54. Понятие «инвестиционные качества ценных бумаг» и формы (методы) их рейтинговой оценки.

55.Модели формирования портфеля инвестиций в ценные бумаги и методы оптимизации инвестиционных портфелей.

56. Стратегии управления инвестиционным портфелем ценных бумаг.

57. Сущность, отличительные особенности и инвестиционные качества финансовых (портфельных) инвестиций

58.Понятие, цели формирования и классификации инвестиционного портфеля.

59.Принципы, этапы формирования и управления инвестиционным портфелем.

60. Понятие о доходе и доходности финансового инструмента

61.Основные показатели и критерии оценки эффективности портфельных инвестиций

62. Классификация типов портфелей

63. Этапы оптимизации структуры инвестиционных портфелей

64. Коэффициент бета и его практическая интерпретация в целях портфельных инвестиций.

65. Использование модели оценки стоимости актива (CAPM) для определения ожидаемых доходности и рисков активов и портфелей

66. Ожидаемая доходность портфеля. Методы расчета.

67. Использование модели Марковица при выборе инвестиционного портфеля

68. Инвестиции в безрисковые активы.

69. Издержки управления портфелем.

70. Пассивное и активное управление инвестиционным портфелем

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
б	а	в	а	в	б	а	б	в	б	а	б	г	в	г

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Критерии оценивания сформированности компетенции (части компетенции)
ПК-3.1. Принимает управленческие решения на основе анализа предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточного для решения задач бизнеса, применения современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; ПК-3.2. Демонстрирует умения разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления и основанных на анализе внутренних (внешних) факторов и	выполнение 70% и более оценочных средств по определению уровня достижения результатов обучения по дисциплине

условий, влияющих на деятельность организации (корпорации) и требований заинтересованных сторон, определяемых выбранным подходом к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; ПК-3.3. Определяет цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации), достигаемых в результате реализации стратегического управления проектами и программами, оценивает соответствие изменений стратегическим целям организации (корпорации) при рассмотрении альтернативных подходов и принятии управленческих решений относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанного на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	

8.2.4. Оценочные средства промежуточного контроля

Примерные вопросы по курсу:

1. Инвестиционная среда. Реальные и финансовые активы. Инвестиционный процесс.
2. Основные участники инвестиционного процесса.
3. Тенденции. Секьюритизация и глобализация. Финансовый инжиниринг.
4. Классификация финансовых инструментов.
5. Производные ценные бумаги.
6. Индексы ценных бумаг.
7. Доходность и риск.
8. Оптимальные портфели.
9. Индексные модели.
10. Коэффициент Шарпа.
11. Доходность и риск.
12. Оптимальные портфели.
13. Диверсификация и портфельный риск.
14. Модель Марковица.
15. Модель оценки долгосрочных активов.
16. Теория арбитражного ценообразования.
17. Многофакторные теории арбитражного ценообразования.
18. Гипотеза эффективного рынка.
19. Тория поведенческих финансов и технический анализ.
20. Индексная модель и однофакторная модель арбитражного ценообразования.
21. Ликвидность и ценообразование на рынке ценных бумаг.
22. Виды портфелей по целям инвестирования
23. Макроэкономический и отраслевой анализ.
24. Особенности инвестиционного портфеля, направленного на минимизацию инвестиционного риска

25. Мультипликаторы оценки инвестиционных качеств акций.
26. Стратегии портфельного инвестирования.
27. Фундаментальный анализ финансового рынка.
28. Основные показатели оценки эффективности портфеля.
29. Стратегия активного управления портфелем.
30. Оптимизация портфеля по принципам доходности и риска.

8.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Основной целью проведения промежуточной аттестации является определение степени достижения целей по учебной дисциплине или ее разделам. Осуществляется это проверкой и оценкой уровня теоретической знаний, полученных обучающимися, умения применять их в решении практических задач, степени овладения обучающимися практическими навыками и умениями в объеме требований рабочей программы по дисциплине, а также их умение самостоятельно работать с учебной литературой.

Организация проведения промежуточной аттестации регламентирована «Положением об организации образовательного процесса в федеральном государственном автономном образовательном учреждении «Московский политехнический университет»

8.3.1. Показатели оценивания компетенций на различных этапах их формирования, достижение обучающимися планируемых результатов обучения по дисциплине

Код и наименование компетенции УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла				
Этап (уровень)	**Критерии оценивания**			
	Неудовлетворительно	**Удовлетворительно**	**Хорошо**	**Отлично**
знать	Обучающийся демонстрирует полное отсутствие или недостаточное соответствие знаний этапов жизненного цикла проекта; особенностей разработки и реализации проекта; методов разработки и управления проектами; особенностей разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла; инструментов планирования целевых этапов жизненного цикла	Обучающийся демонстрирует неполное соответствие знаний этапов жизненного цикла проекта; особенностей разработки и реализации проекта; методов разработки и управления проектами; особенностей разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла; инструментов планирования целевых	Обучающийся демонстрирует частичное соответствие знаний этапов жизненного цикла проекта; особенностей разработки и реализации проекта; методов разработки и управления проектами; особенностей разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла;	Обучающийся демонстрирует полное соответствие знаний этапов жизненного цикла проекта; особенностей разработки и реализации проекта; методов разработки и управления проектами; особенностей разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла;

	проекта; методик разработки и управления проектом; методов оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	этапов жизненного цикла проекта; методик разработки и управления проектом; методов оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта..	инструментов планирования целевых этапов жизненного цикла проекта; методик разработки и управления проектом; методов оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта..	инструментов планирования целевых этапов жизненного цикла проекта; методик разработки и управления проектом; методов оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта..
уметь	Обучающийся не умеет или в недостаточной степени умеет разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла; анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта.	Обучающийся демонстрирует неполное соответствие умений разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла; анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта.	Обучающийся демонстрирует частичное соответствие умений разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла; анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта.	Обучающийся демонстрирует полное соответствие умений разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла; анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта.

владеть	Обучающийся не владеет или в недостаточной степени владеет методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла; методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах); методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.	Обучающийся владеет в неполном объеме и проявляет недостаточность владения методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла; методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах); методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.	Обучающимся допускаются незначительные ошибки, неточности, затруднения, частично владеет методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла; методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах); методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.	Обучающийся свободно применяет полученные навыки, в полном объеме владеет методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла; методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах); методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.

Код и наименование компетенции ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)

Этап (уровень)	**Критерии оценивания**			
	неудовлетворительно	**удовлетворительно**	**хорошо**	**отлично**
знать	Обучающийся демонстрирует полное отсутствие или недостаточное соответствие знаний предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме,	Обучающийся демонстрирует неполное соответствие знаний предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточном для	Обучающийся демонстрирует частичное соответствие знаний предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в	Обучающийся демонстрирует полное соответствие знаний предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточном

	достаточном для решения задач бизнеса; современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; принципов и методов разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации); видов и методов принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса.	решения задач бизнеса; современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; принципов и методов разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации); видов и методов принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса.	объеме, достаточном для решения задач бизнеса; современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; принципов и методов разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации); видов и методов принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса.	для решения задач бизнеса; современной методологии управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; принципов и методов разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации); видов и методов принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса.
уметь	Обучающийся не умеет или в недостаточной степени умеет применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные концепции социальной ответственности бизнеса при разработке и	Обучающийся демонстрирует неполное соответствие умений применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные концепции социальной ответственности	Обучающийся демонстрирует частичное соответствие умений применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные	Обучающийся демонстрирует полное соответствие умений применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные концепции

	совершенствовании системы корпоративного управления; разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации); определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации); определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	концепции социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации); определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.	социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации); определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной ответственности бизнеса.
владеть	Обучающийся не владеет или в недостаточной степени владеет навыками внесения совершенствований в системы корпоративного управления на основе применения современных	Обучающийся владеет в неполном объеме и проявляет недостаточность владения навыками внесения совершенствований в системы корпоративного	Обучающимся допускаются незначительные ошибки, неточности, затруднения, частично владеет навыками внесения совершенствований	Обучающийся свободно применяет полученные навыки, в полном объеме владеет навыками внесения совершенствований в системы корпоративного

	методологий и стандартов управления проектами и программами; навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; навыками управления изменениями в части внесения корректировок в управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений	управления на основе применения современных методологий и стандартов управления проектами и программами; навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; навыками управления изменениями в части внесения корректировок в управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений.	в системы корпоративного управления на основе применения современных методологий и стандартов управления проектами и программами; навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; навыками управления изменениями в части внесения корректировок в управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений .	управления на основе применения современных методологий и стандартов управления проектами и программами; навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; навыками управления изменениями в части внесения корректировок в управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений.

8.3.2. Методика оценивания результатов промежуточной аттестации

Показателями оценивания компетенций на этапе промежуточной аттестации по дисциплине «Портфельное инвестирование» являются результаты обучения по дисциплине.

Оценочный лист результатов обучения по дисциплине

Код компетенции	Знания	Умения	Навыки	Уровень сформированности компетенции на данном этапе / оценка

УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	знаний этапов жизненного цикла проекта; особенностей разработки и реализации проекта; методов разработки и управления проектами; особенностей разработки и реализации проекта на всех этапах его жизненного цикла; инструментов планирования целевых этапов жизненного цикла проекта; методик разработки и управления проектом; методов оценки потребности в ресурсах и эффективности проекта.	разрабатывать проект; планировать целевые этапы и основные направления работ; управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла; анализировать альтернативные варианты реализации проекта; планировать целевые этапы и основные направления работ; формулировать цель, задачи, обосновывать актуальность, научную и практическую значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы применения; осуществлять мониторинг хода реализации проекта; вносить при необходимости изменения в план реализации проекта; определять потребности в ресурсах, необходимых для реализации проектов; оценивать эффективность проекта.	владеть методиками разработки и управления проектом; навыками разработки проектов и управления на всех этапах его жизненного цикла; методиками разработки и управления проектом; навыками подготовки публичного представления проектов в различных формах (отчеты, статьи, выступления на научно-практических конференциях, семинарах); методами оценки потребности в ресурсах; навыками оценки эффективности проекта на всех этапах его жизненного цикла.	
ПК-3. Способен разрабатывать стратегии управления проектами и программами, использования современных концепций социальной ответственности бизнеса в	предметной области и специфики деятельности организации (корпорации) в объеме, достаточном для решения задач бизнеса; современной методологии	применять современную методологию управления проектами и программами, актуальные концепции социальной ответственности бизнеса при разработке и	внесения совершенствований в системы корпоративного управления на основе применения современных методологий и стандартов управления проектами и программами;	

реализации корпоративного управления, в т.ч. при управлении изменениями в организации (корпорации)	управления проектами и программами, актуальных концепций социальной ответственности бизнеса при разработке и совершенствовании системы корпоративного управления; принципов и методов разработки и реализации стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; внутренних (внешних) факторов и условий, влияющих на деятельность организации (корпорации); видов и методов принятия управленческих решений, подходов к оценке эффективности стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса	совершенствовании системы корпоративного управления; разрабатывать и реализовывать стратегические проекты, реализуемые системой корпоративного управления; анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации (корпорации); определять цель и задачи стратегических изменений в организации (корпорации); оценивать альтернативные подходы и принимать эффективное (результативное) управленческое решение относительно выбора стратегии управления проектами и программами, основанное на использовании современных концепций социальной	навыками управления содержанием, ресурсами и сроками стратегических проектов, реализуемых системой корпоративного управления; навыками определения подходов к использованию современных концепций социальной ответственности бизнеса; навыками управления изменениями в части внесения корректировок в управленческие решения по выбору стратегии управления проектами и программами, ориентированными на повышение социальной ответственности бизнеса, а также оценки последствий принимаемых решений	
Оценка по дисциплине (среднее арифметическое)				

Оценка по дисциплине зависит от уровня сформированности компетенций, закрепленных за дисциплиной и представляет собой среднее арифметическое от выставленных оценок по отдельным результатам обучения (знания, умения, навыки).

Оценка «отлично» выставляется, если среднее арифметическое находится в интервале от 4,5 до 5,0. Оценка «хорошо» выставляется, если среднее арифметическое находится в интервале от 3,5 до 4,4. Оценка

«удовлетворительно» выставляется, если среднее арифметическое находится в интервале от 2,5 до 3,4. Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если среднее арифметическое находится в интервале от 0 до 2,4.

Промежуточная аттестация обучающихся проводится по результатам выполнения всех видов учебной работы, предусмотренных учебным планом по дисциплине «Портфельное инвестирование», при этом учитываются результаты текущего контроля успеваемости в течение семестра. Оценка степени достижения обучающимися планируемых результатов обучения по дисциплине проводится преподавателем, ведущим занятия по дисциплине методом экспертной оценки. По итогам промежуточной аттестации по дисциплине выставляется оценка «отлично», «хорошо», «удовлетворительно» или «неудовлетворительно».

Шкала оценивания	**Описание**
Отлично	Выполнены все виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. Студент демонстрирует соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателей, оперирует приобретенными знаниями, умениями, навыками, применяет их в ситуациях повышенной сложности. При этом могут быть допущены незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.
Хорошо	Выполнены все виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. Студент демонстрирует неполное, правильное соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателей, либо если при этом были допущены 2-3 несущественные ошибки.
Удовлетворительно	Выполнены все виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. Студент демонстрирует соответствие знаний, в котором освещена основная, наиболее важная часть материала, но при этом допущена одна значительная ошибка или неточность.
Неудовлетворительно	Не выполнен один или более видов учебной работы, предусмотренных учебным планом. Студент демонстрирует неполное соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателей, допускаются значительные ошибки, проявляется отсутствие знаний, умений, навыков по ряду показателей, студент испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

9. Электронная информационно-образовательная среда

Каждый обучающийся в течение всего периода обучения обеспечивается индивидуальным неограниченным доступом к электронной информационно-образовательной среде Чебоксарского института (филиала) Московского

политехнического университета из любой точки, в которой имеется доступ к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сеть «Интернет»), как на территории филиала, так и вне ее.

Электронная информационно-образовательная среда – совокупность информационных и телекоммуникационных технологий, соответствующих технологических средств, обеспечивающих освоение обучающимися образовательных программ в полном объёме независимо от места нахождения обучающихся.

Электронная информационно-образовательная среда обеспечивает:

а) доступ к учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), практик, электронным учебным изданиям и электронным образовательным ресурсам, указанным в рабочих программах дисциплин (модулей), практик;

б) формирование электронного портфолио обучающегося, в том числе сохранение его работ и оценок за эти работы;

в) фиксацию хода образовательного процесса, результатов промежуточной аттестации и результатов освоения программы бакалавриата;

г) проведение учебных занятий, процедур оценки результатов обучения, реализация которых предусмотрена с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий;

д) взаимодействие между участниками образовательного процесса, в том числе синхронное и (или) асинхронное взаимодействия посредством сети «Интернет».

Функционирование электронной информационно-образовательной среды обеспечивается соответствующими средствами информационно-коммуникационных технологий и квалификацией работников, ее использующих и поддерживающих.

Функционирование электронной информационно-образовательной среды соответствует законодательству Российской Федерации.

Основными составляющими ЭИОС филиала являются:

а) сайт института в сети Интернет, расположенный по адресу www.polytech21.ru, https://chebpolytech.ru/ который обеспечивает:

- доступ обучающихся к учебным планам, рабочим программам дисциплин, практик, к изданиям электронных библиотечных систем, электронным информационным и образовательным ресурсам, указанных в рабочих программах (разделы сайта «Сведения об образовательной организации»);

- информирование обучающихся обо всех изменениях учебного процесса (новостная лента сайта, лента анонсов);

- взаимодействие между участниками образовательного процесса (подразделы сайта «Задать вопрос директору»);

б) официальные электронные адреса подразделений и сотрудников института с Яндекс-доменом @polytech21.ru (список контактных данных подразделений Филиала размещен на официальном сайте Филиала в разделе «Контакты», списки контактных официальных электронных данных

преподавателей размещены в подразделах «Кафедры») обеспечивают взаимодействие между участниками образовательного процесса;

в) личный кабинет обучающегося (портфолио) (вход в личный кабинет размещен на официальном сайте Филиала в разделе «Студенту» подразделе «Электронная информационно-образовательная среда») включает в себя портфолио студента, электронные ведомости, рейтинг студентов и обеспечивает:

- фиксацию хода образовательного процесса, результатов промежуточной аттестации и результатов освоения образовательных программ обучающимися,

- формирование электронного портфолио обучающегося, в том числе с сохранение работ обучающегося, рецензий и оценок на эти работы,

г) электронные библиотеки, включающие электронные каталоги, полнотекстовые документы и обеспечивающие доступ к учебно-методическим материалам, выпускным квалификационным работам и т.д.:

Чебоксарского института (филиала) - «ИРБИС»

д) электронно-библиотечные системы (ЭБС), включающие электронный каталог и полнотекстовые документы:

- «ЛАНЬ» -www.e.lanbook.com

- Образовательная платформа Юрайт -https://urait.ru

е) платформа цифрового образования Политеха -https://lms.mospolytech.ru/

ж) система «Антиплагиат» -https://www.antiplagiat.ru/

з) система электронного документооборота DIRECTUM Standard — обеспечивает документооборот между Филиалом и Университетом;

и) система «1С Управление ВУЗом Электронный деканат» (Московский политехнический университет) обеспечивает фиксацию хода образовательного процесса, результатов промежуточной аттестации и результатов освоения образовательных программ обучающимися;

к) система «POLYTECH systems» обеспечивает информационное, документальное автоматизированное сопровождение образовательного процесса;

л) система «Абитуриент» обеспечивает документальное автоматизированное сопровождение работы приемной комиссии.

10. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Основная литература

1. Основы портфельного инвестирования : учебник для вузов / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 195 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07092-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/513123

2. Кузнецов, Б. Т. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов / Б. Т. Кузнецов. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт,

2023. — 363 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02215-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/511016

Дополнительная литература

1. Кузнецова, Е. В. Управление портфелем проектов как инструмент реализации корпоративной стратегии : учебник для вузов / Е. В. Кузнецова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 177 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07425-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/512289
2. Лимитовский, М. А. Инвестиционные проекты и реальные опционы на развивающихся рынках : учебное пособие для вузов / М. А. Лимитовский. — 5-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 486 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02878-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/510474.

Периодика:

1. Журнал экономических исследований : сетевой научный журнал / гл. ред. В. М. Прудников. – Москва : ИНФРА-М. – URL: https://naukaru.ru/ru/nauka/journal/55/view#archieve.
2. Управление персоналом и интеллектуальными ресурсами в России : научно-практический журнал / гл. ред. В. М. Свистунов. – Москва : ИНФРА-М. – URL: https://naukaru.ru/ru/nauka/journal/12/view
3. НИР. Экономика фирмы: научно-практический журнал /гл. ред. Гарнов А.П. – Москва: НИЦ ИНФРА-М – URL: https://naukaru.ru/ru/nauka/journal/11/view

11. Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы

Профессиональная база данных и информационно-справочные системы	Информация о праве собственности (реквизиты договора)
Справочная правовая система (СПС) «КонсультантПлюс» http://www.consultant.ru/	Законодательство РФ кодексы и законы в последней редакции. Удобный поиск законов кодексов приказов и других документов. Ежедневные обзоры законов. Консультации по бухучету и налогообложению.
Электронный периодический справочник «Система ГАРАНТ» https://www.garant.ru/	Законодательство - законы и кодексы Российской Федерации. Полные тексты документов в последней редакции. Аналитические профессиональные материалы.
Университетская информационная система РОССИЯ https://uisrussia.msu.ru/	Тематическая электронная библиотека и база для прикладных исследований в области экономики, управления, социологии, лингвистики, философии, филологии, международных отношений, права. свободный доступ
научная электронная	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU - это

библиотека Elibrary http://elibrary.ru/	крупнейший российский информационно-аналитический портал в области науки, технологии, медицины и образования, содержащий рефераты и полные тексты более 26 млн научных статей и публикаций, в том числе электронные версии более 5600 российских научно-технических журналов, из которых более 4800 журналов в открытом доступе свободный доступ
сайт Института научной информации по общественным наукам РАН. http://www.inion.ru	Библиографические базы данных ИНИОН РАН по социальным и гуманитарным наукам ведутся с начала 1980-х годов. Общий объём массивов составляет более 3 млн. 500 тыс. записей (данные на 1 января 2012 г.). Ежегодный прирост — около 100 тыс. записей. В базы данных включаются аннотированные описания книг и статей из журналов и сборников на 140 языках, поступивших в Фундаментальную библиотеку ИНИОН РАН. Описания статей и книг в базах данных снабжены шифром хранения и ссылками на полные тексты источников из Научной электронной библиотеки.
Федеральный портал «Российское образование» [Электронный ресурс] – http://www.edu.ru	Федеральный портал «Российское образование» – уникальный интернет-ресурс в сфере образования и науки. Ежедневно публикует самые актуальные новости, анонсы событий, информационные материалы для широкого круга читателей. Еженедельно на портале размещаются эксклюзивные материалы, интервью с ведущими специалистами – педагогами, психологами, учеными, репортажи и аналитические статьи. Читатели получают доступ к нормативно-правовой базе сферы образования, они могут пользоваться самыми различными полезными сервисами – такими, как онлайн-тестирование, опросы по актуальным темам и т.д.
Федеральный портал «Экономика. Социология. Менеджмент» http://ecsocman.hse.ru/books/	Информационное обеспечение образовательного сообщества России учебными и методическими материалами по образованию в области экономики, социологии и менеджмента.

Название организации	**Сокращённое название**	**Организационно-правовая форма**	**Отрасль (область деятельности)**	**Официальный сайт**
Ассоциация менеджеров России	АМР	Российская общественная организация	менеджмент	https://amr.ru/

12. Программное обеспечение (лицензионное и свободно распространяемое), используемое при осуществлении образовательного процесса

Аудитория	Программное обеспечение	Информация о праве собственности (реквизиты договора, номер лицензии и т.д.)
Учебная аудитория для	Kaspersky Endpoint Security	Номер лицензии 2B1E-211224-

проведения учебных занятий всех видов, предусмотренных программой магистратуры, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) Кабинет экономики и менеджмента № 203 (г. Чебоксары, ул. К.Маркса. 54)	Стандартный Educational Renewal 2 года. Band S: 150-249	064549-2-19382 Сублицензионный договор №821_832.223.3К/21 от 24.12.2021 до 31.12.2023
	Windows 7 OLPNLAcdmc	договор №Д03 от 30.05.2012) с допсоглашениями от 29.04.14 и 01.09.16 (бессрочная лицензия)
	AdobeReader	свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	Гарант	Договор № 735_480.2233К/20 от 15.12.2020
	Yandex браузер	отечественное свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	Microsoft Office Standard 2007(Microsoft DreamSpark Premium Electronic Software Delivery Academic(Microsoft Open License	номер лицензии-42661846 от 30.08.2007) с допсоглашениями от 29.04.14 и 01.09.16 (бессрочная лицензия)
	Zoom	свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	AIMP	отечественное свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
Учебная аудитория для проведения учебных занятий всех видов, предусмотренных программой магистратуры, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) Кабинет экономики и менеджмента № 103 (г. Чебоксары, ул. К.Маркса. 54)	Kaspersky Endpoint Security Стандартный Educational Renewal 2 года. Band S: 150-249	Номер лицензии 2B1E-211224-064549-2-19382 Сублицензионный договор №821_832.223.3К/21 от 24.12.2021 до 31.12.2023
	Windows 7 OLPNLAcdmc	договор №Д03 от 30.05.2012) с допсоглашениями от 29.04.14 и 01.09.16 (бессрочная лицензия)
	AdobeReader	свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	Microsoft Office Standard 2007(Microsoft DreamSpark Premium Electronic Software Delivery Academic(Microsoft Open License	номер лицензии-42661846 от 30.08.2007) с допсоглашениями от 29.04.14 и 01.09.16 (бессрочная лицензия)
	Гарант	Договор № 735_480.2233К/20 от 15.12.2020
	Yandex браузер	отечественное свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	AIMP	отечественное свободно распространяемое программное

		обеспечение (бессрочная лицензия)
Помещение для самостоятельной работы обучающихся № 103а	Kaspersky Endpoint Security Стандартный Educational Renewal 2 года. Band S: 150-249	Номер лицензии 2B1E-211224-064549-2-19382 Сублицензионный договор №821_832.223.3К/21 от 24.12.2021 до 31.12.2023
	MS Windows 10 Pro	договор № 392_469.223.3К/19 от 17.12.19 (бессрочная лицензия)
	AdobeReader	свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	Гарант	Договор № 735_480.223.3К/20
	Yandex браузер	свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)
	Microsoft Office Standard 2007(Microsoft DreamSpark Premium Electronic Software Delivery Academic(Microsoft Open License	номер лицензии-42661846 от 30.08.2007) с допсоглашениями от 29.04.14 и 01.09.16 (бессрочная лицензия)
	AIMP	отечественное свободно распространяемое программное обеспечение (бессрочная лицензия)

13. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип и номер помещения	Перечень основного оборудования и технических средств обучения
Учебная аудитория для проведения учебных занятий всех видов, предусмотренных программой магистратуры, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) Кабинет экономики и менеджмента № 203 (г. Чебоксары, ул. К.Маркса. 54)	Оборудование: комплект мебели для учебного процесса; доска учебная; Технические средства обучения: компьютерная техника; мультимедийное оборудование (проектор, экран).
Учебная аудитория для проведения учебных занятий всех видов, предусмотренных программой магистратуры, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) Кабинет экономики и менеджмента № 103 (г. Чебоксары, ул. К.Маркса. 54)	Оборудование: комплект мебели для учебного процесса; доска учебная; стенды Технические средства обучения: компьютерная техника; мультимедийное оборудование (проектор, экран)
Помещение для самостоятельной работы обучающихся № 103а (г. Чебоксары, ул. К.Маркса. 54)	Оборудование: комплект мебели для учебного процесса; Технические средства обучения: компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Филиала

14. Методические указания для обучающегося по освоению дисциплины

Методические указания для занятий лекционного типа

В ходе лекционных занятий обучающемуся необходимо вести конспектирование учебного материала, обращать внимание на категории, формулировки, раскрывающие содержание тех или иных явлений и процессов, научные выводы и практические рекомендации.

Необходимо задавать преподавателю уточняющие вопросы с целью уяснения теоретических положений, разрешения спорных ситуаций. Целесообразно дорабатывать свой конспект лекции, делая в нем соответствующие записи из основной и дополнительной литературы, рекомендованной преподавателем и предусмотренной учебной программой дисциплины.

Методические указания для занятий семинарского (практического) типа.

Практические занятия позволяют развивать у обучающегося творческое теоретическое мышление, умение самостоятельно изучать литературу, анализировать практику; учат четко формулировать мысль, вести дискуссию, то есть имеют исключительно важное значение в развитии самостоятельного мышления.

Подготовка к практическому занятию включает два этапа. На первом этапе обучающийся планирует свою самостоятельную работу, которая включает: уяснение задания на самостоятельную работу; подбор основной и дополнительной литературы; составление плана работы, в котором определяются основные пункты предстоящей подготовки. Составление плана дисциплинирует и повышает организованность в работе.

Второй этап включает непосредственную подготовку к занятию, которая начинается с изучения основной и дополнительной литературы. Особое внимание при этом необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов. Далее следует подготовить тезисы для выступлений по всем учебным вопросам, выносимым на практическое занятие или по теме, вынесенной на дискуссию (круглый стол), продумать примеры с целью обеспечения тесной связи изучаемой темы с реальной жизнью.

Готовясь к докладу или выступлению в рамках интерактивной формы (дискуссия, круглый стол), при необходимости следует обратиться за помощью к преподавателю.

Методические указания к самостоятельной работе.

Самостоятельная работа обучающегося является основным средством овладения учебным материалом во время, свободное от обязательных учебных занятий. Самостоятельная работа обучающегося над усвоением учебного материала по учебной дисциплине может выполняться в библиотеке университета, учебных кабинетах, компьютерных классах, а также в домашних

условиях. Содержание и количество самостоятельной работы обучающегося определяется учебной программой дисциплины, методическими материалами, практическими заданиями и указаниями преподавателя.

***Самостоятельная работа в аудиторное время может включать**:*

1) конспектирование (составление тезисов) лекций;
2) выполнение контрольных работ;
3) решение задач;
4) работу со справочной и методической литературой;
5) работу с нормативными правовыми актами;
6) выступления с докладами, сообщениями на семинарских занятиях;
7) защиту выполненных работ;
8) участие в оперативном (текущем) опросе по отдельным темам изучаемой дисциплины;
9) участие в собеседованиях, деловых (ролевых) играх, дискуссиях, круглых столах, конференциях;
10) участие в тестировании и др.

Самостоятельная работа во внеаудиторное время может состоять из:

1) повторения лекционного материала;
2) подготовки к практическим занятиям;
3) изучения учебной и научной литературы;
4) изучения нормативных правовых актов (в т.ч. в электронных базах данных);
5) решения задач, и иных практических заданий
6) подготовки к контрольным работам, тестированию и т.д.;
7) подготовки к практическим занятиям устных докладов (сообщений);
8) подготовки рефератов, эссе и иных индивидуальных письменных работ по заданию преподавателя;
9) выполнения курсовых работ, предусмотренных учебным планом;
10) выполнения выпускных квалификационных работ и др.
11) выделения наиболее сложных и проблемных вопросов по изучаемой теме, получение разъяснений и рекомендаций по данным вопросам с преподавателями на консультациях.
12) проведения самоконтроля путем ответов на вопросы текущего контроля знаний, решения представленных в учебно-методических материалах кафедры задач, тестов, написания рефератов и эссе по отдельным вопросам изучаемой темы.

Текущий контроль осуществляется в форме устных, тестовых опросов, докладов, творческих заданий.

В случае пропусков занятий, наличия индивидуального графика обучения и для закрепления практических навыков студентам могут быть выданы типовые индивидуальные задания, которые должны быть сданы в установленный преподавателем срок.

15. Особенности реализации дисциплины для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

Обучение по дисциплине «Портфельное инвестирование» инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (далее ОВЗ) осуществляется преподавателем с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся.

Для студентов с нарушениями опорно-двигательной функции и с ОВЗ по слуху предусматривается сопровождение лекций и практических занятий мультимедийными средствами, раздаточным материалом.

Для студентов с ОВЗ по зрению предусматривается применение технических средств усиления остаточного зрения, а также предусмотрена возможность разработки аудиоматериалов.

По дисциплине «Портфельное инвестирование» обучение инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья может осуществляться как в аудитории, так и с использованием электронной информационно-образовательной среды, образовательного портала и электронной почты.

ЛИСТ ДОПОЛНЕНИЙ И ИЗМЕНЕНИЙ
рабочей программы дисциплины

Рабочая программа дисциплины рассмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры, протокол № 10 от «22» августа 2023 г.

Внесены дополнения и изменения в части актуализации электронных библиотечных систем.

Рабочая программа дисциплины рассмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 202__-202__ учебном году на заседании кафедры, протокол № ___ от « » 202 г.

Внесены дополнения и изменения _____
_____
_____
_____
_____

Рабочая программа дисциплины рассмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 202__-202__ учебном году на заседании кафедры, протокол № ___ от « » 202 г.

Внесены дополнения и изменения _____
_____
_____
_____
_____

Рабочая программа дисциплины рассмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 202__-202__ учебном году на заседании кафедры, протокол № ___ от « » 202 г.

Внесены дополнения и изменения _____
_____
_____
_____
_____