

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования "Пермский
государственный национальный исследовательский
университет"**

Кафедра финансов, кредита и биржевого дела

Авторы-составители: **Шубин Константин Александрович**

Рабочая программа дисциплины

УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

Код УМК 73570

Утверждено
Протокол №4
от «25» мая 2020 г.

Пермь, 2020

1. Наименование дисциплины

Управление инвестиционным портфелем

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина входит в вариативную часть Блока « Б.1 » образовательной программы по направлениям подготовки (специальностям):

Направление: **38.03.01** Экономика
направленность Финансы и кредит

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

В результате освоения дисциплины **Управление инвестиционным портфелем** у обучающегося должны быть сформированы следующие компетенции:

38.03.01 Экономика (направленность : Финансы и кредит)

ПК.10 способность использовать для решения управленческих задач современные технические средства и информационные технологии

ПК.11 способность критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

ПК.12 владеет методами оценки и управления проектами и готов к их реализации

ПК.17 способность выполнять операции и использовать различные инструменты и технологии в банковской деятельности

ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта

4. Объем и содержание дисциплины

Направления подготовки	38.03.01 Экономика (направленность: Финансы и кредит)
форма обучения	очная
№№ триместров, выделенных для изучения дисциплины	10
Объем дисциплины (з.е.)	3
Объем дисциплины (ак.час.)	108
Контактная работа с преподавателем (ак.час.), в том числе:	42
Проведение лекционных занятий	14
Проведение практических занятий, семинаров	28
Самостоятельная работа (ак.час.)	66
Формы текущего контроля	Входное тестирование (1) Итоговое контрольное мероприятие (1) Письменное контрольное мероприятие (3)
Формы промежуточной аттестации	Зачет (10 триместр)

5. Аннотированное описание содержания разделов и тем дисциплины

УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

Входной контроль

Проверка остаточных знаний по предшествующим дисциплинам: понятийный и математический аппарат (инвестиционные качества финансовых инструментов, доход, доходность, риск).

1. Портфельное инвестирование: экономическая сущность и принципы формирования портфеля

Понятие портфельного инвестирования. Цели портфельного инвестирования. Финансовые активы и их классификация. Понятие инвестиционного портфеля и их классификации. Принципы формирования инвестиционного портфеля. Ожидаемая доходность и риск портфеля.

2. Создание инвестиционной декларации модельного инвестиционного портфеля

Классическая портфельная теория. Модель оценки финансовых активов (САРМ). Модификации САРМ. Модель У. Шарпа. Коэффициент детерминации. Определение равенства линии характеристики и коэффициента детерминации. Определение набора эффективных портфелей. Прогнозирование величины бета. Многофакторные модели. Арбитражная модель росса. Многофакторное моделирование портфеля.

3. Определение стратегий управления модельным инвестиционным портфелем

Доходность и риск инвестиционного инструмента. Ликвидность. Доходность и риск инвестиционного портфеля. Пассивные и активные стратегии. Механические стратегии по размещению средств по классам активов. Активные и пассивные стратегии.

4. Создание модельного инвестиционного портфеля

Подходы к формированию портфеля. Моделирование краткосрочного спекулятивного портфеля. Хеджирование инвестиционного портфеля. Оценка эффективности управления портфелем. Показатели эффективности управления портфелем. Показатели способности менеджера прогнозировать доходности активов и конъюнктуру. Омега. Разложение доходности на составляющие компоненты.

Комплексный итоговый контроль

Итоговое контрольное мероприятие по дисциплине.

6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Освоение дисциплины требует систематического изучения всех тем в той последовательности, в какой они указаны в рабочей программе.

Основными видами учебной работы являются аудиторские занятия. Их цель - расширить базовые знания обучающихся по осваиваемой дисциплине и систему теоретических ориентиров для последующего более глубокого освоения программного материала в ходе самостоятельной работы. Обучающемуся важно помнить, что контактная работа с преподавателем эффективно помогает ему овладеть программным материалом благодаря расстановке необходимых акцентов и удержанию внимания интонационными модуляциями голоса, а также подключением аудио-визуального механизма восприятия информации.

Самостоятельная работа преследует следующие цели:

- закрепление и совершенствование теоретических знаний, полученных на лекционных занятиях;
- формирование навыков подготовки текстовой составляющей информации учебного и научного назначения для размещения в различных информационных системах;
- совершенствование навыков поиска научных публикаций и образовательных ресурсов, размещенных в сети Интернет;
- самоконтроль освоения программного материала.

Обучающемуся необходимо помнить, что результаты самостоятельной работы контролируются преподавателем во время проведения мероприятий текущего контроля и учитываются при промежуточной аттестации.

Обучающимся с ОВЗ и инвалидов предоставляется возможность выбора форм проведения мероприятий текущего контроля, альтернативных формам, предусмотренным рабочей программой дисциплины. Предусматривается возможность увеличения в пределах 1 академического часа времени, отводимого на выполнение контрольных мероприятий.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

При проведении текущего контроля применяются оценочные средства, обеспечивающие передачу информации, от обучающегося к преподавателю, с учетом психофизиологических особенностей здоровья обучающихся.

7. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

При самостоятельной работе обучающимся следует использовать:

- конспекты лекций;
- литературу из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля);
- текст лекций на электронных носителях;
- ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимые для освоения дисциплины;
- лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение из перечня информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине;
- методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

Основная:

1. Основы портфельного инвестирования : учебник для бакалавриата и магистратуры / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 195 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07092-7. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/436994>
2. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 с. — ISBN 978-5-9614-0775-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. <http://www.iprbookshop.ru/82378.html>

Дополнительная:

1. Чижик, В. П. Инвестиционный анализ и управление инвестиционным портфелем фирмы : учебное пособие / В. П. Чижик, В. Л. Рачек, Н. М. Калинина. — Омск : Омский государственный институт сервиса, Омский государственный технический университет, 2012. — 256 с. — ISBN 978-5-93252-254-7. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. <http://www.iprbookshop.ru/12697>
2. Бочаров В. В. Инвестиции: Инвестиционный портфель. Источники финансирования. Выбор стратегии/В. В. Бочаров.-СПб.:Питер,2003, ISBN 5-94723-037-2.-288.-Библиогр.: с. 282-286

9. Перечень ресурсов сети Интернет, необходимых для освоения дисциплины

<http://www.consultant.ru/> Интернет-версия системы «Консультант+»

<https://elibrary.ru/> Научная электронная библиотека

<http://www.mirkin.ru/> Портал "Финансовые науки"

<https://www.rbc.ru/> Интернет-портал РБК

<https://www.gks.ru/> Федеральная служба государственной статистики РФ

<https://cbr.ru/> Центральный банк РФ

<https://investfunds.ru/> Интернет-портал для инвесторов

<http://moex.com/> Московская биржа

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

Образовательный процесс по дисциплине **Управление инвестиционным портфелем** предполагает использование следующего программного обеспечения и информационных справочных систем:

- 1) презентационные материалы (слайды по темам лекционных занятий);
- 2) доступ в режиме on-line в Электронную библиотечную систему (ЭБС);
- 3) доступ в электронную информационно-образовательную среду университета;
- 4) интернет-сервисы и электронные ресурсы.

Перечень необходимого лицензионного и (или) свободно распространяемого программного обеспечения:

1. приложения, позволяющее просматривать и воспроизводить медиаконтент PDF-файлов;
2. офисные пакеты приложений;
3. программы для демонстрации видеоматериалов

При освоении материала и выполнения заданий по дисциплине рекомендуется использование материалов, размещенных в Личных кабинетах обучающихся ЕТИС ПГНИУ (student.psu.ru).

При организации дистанционной работы и проведении занятий в режиме онлайн могут использоваться:

система видеоконференцсвязи на основе платформы BigBlueButton (<https://bigbluebutton.org/>).

система LMS Moodle (<http://e-learn.psu.ru/>), которая поддерживает возможность использования текстовых материалов и презентаций, аудио- и видеоконтент, а так же тесты, проверяемые задания, задания для совместной работы.

система тестирования Indigo (<https://indigotech.ru/>).

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Лекционные занятия – аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или маркерной доской.

Занятий практического типа – аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или маркерной доской.

Текущий контроль, индивидуальные и групповые консультации, промежуточная аттестация – аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или маркерной доской.

Самостоятельная работа – аудитория для самостоятельной работы, оснащенная компьютерной техникой

с возможностью подключения к сети «Интернет», обеспеченная доступом в электронную информационно-образовательную среду университета, а так же к научной библиотеке ПГНИУ.

Помещения научной библиотеки ПГНИУ для обеспечения самостоятельной работы обучающихся:

1. Научно-библиографический отдел, корп.1, ауд. 142. Оборудован 3 персональными компьютера с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

2. Читальный зал гуманитарной литературы, корп. 2, ауд. 418. Оборудован 7 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

3. Читальный зал естественной литературы, корп.6, ауд. 107а. Оборудован 5 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

4. Отдел иностранной литературы, корп.2 ауд. 207. Оборудован 1 персональным компьютером с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

5. Библиотека юридического факультета, корп.9, ауд. 4. Оборудована 11 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

6. Читальный зал географического факультета, корп.8, ауд. 419. Оборудован 6 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

Все компьютеры, установленные в помещениях научной библиотеки, оснащены следующим программным обеспечением:

Операционная система ALT Linux;

Офисный пакет Libreoffice.

Справочно-правовая система «КонсультантПлюс»

**Фонды оценочных средств для аттестации по дисциплине
Управление инвестиционным портфелем**

**Планируемые результаты обучения по дисциплине для формирования компетенции и
критерии их оценивания**

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
<p>ПК.10 способность использовать для решения управленческих задач современные технические средства и информационные технологии</p>	<p>знать основные современные информационно-коммуникационные технологии, используемые для целей анализа инвестиционных качеств активов и инвестиционного портфеля, уметь осуществлять выбор соответствующих поставленной задаче технических средств и информационно-коммуникационных технологий, владеть навыком применения общедоступных технических средств и информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению инвестиционным портфелем</p>	<p align="center">Неудовлетворител</p> <p>знает отдельные современные информационно-коммуникационные технологии, используемые для целей анализа инвестиционных качеств активов и инвестиционного портфеля, не умеет осуществлять выбор соответствующих поставленной задаче технических средств и информационно-коммуникационных технологий, не владеет навыком применения общедоступных технических средств и информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению инвестиционным портфелем</p> <p align="center">Удовлетворительн</p> <p>знает отдельные современные информационно-коммуникационные технологии, используемые для целей анализа инвестиционных качеств активов и инвестиционного портфеля, частично умеет осуществлять выбор соответствующих поставленной задаче технических средств и информационно-коммуникационных технологий, частично владеет навыком применения общедоступных технических средств и информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению инвестиционным портфелем</p> <p align="center">Хорошо</p> <p>знает основные современные информационно-коммуникационные технологии, используемые для целей анализа инвестиционных качеств активов и инвестиционного портфеля, умеет осуществлять выбор соответствующих поставленной задаче технических средств и</p>

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
		<p style="text-align: center;">Хорошо</p> <p>информационно-коммуникационных технологий, не в полной мере владеет навыком применения общедоступных технических средств и информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению инвестиционным портфелем</p> <p style="text-align: center;">Отлично</p> <p>знает основные современные информационно-коммуникационные технологии, используемые для целей анализа инвестиционных качеств активов и инвестиционного портфеля, умеет осуществлять выбор соответствующих поставленной задаче технических средств и информационно-коммуникационных технологий, в полной мере владеет навыком применения общедоступных технических средств и информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению инвестиционным портфелем</p>
<p>ПК.11 способность критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий</p>	<p>знать подходы и методы оценки эффективности и рисков управления инвестиционным портфелем, уметь осуществлять выбор показателей оценки эффективности управления инвестиционным портфелем, владеть навыком разработки и обоснования стратегий управления инвестиционным портфелем с учетом критериев эффективности и рисков</p>	<p style="text-align: center;">Неудовлетворител</p> <p>знает отдельные подходы и методы оценки эффективности и рисков управления инвестиционным портфелем, не умеет осуществлять выбор показателей оценки эффективности управления инвестиционным портфелем, не владеет навыком разработки и обоснования стратегий управления инвестиционным портфелем с учетом критериев эффективности и рисков</p> <p style="text-align: center;">Удовлетворительн</p> <p>знает отдельные подходы и методы оценки эффективности и рисков управления инвестиционным портфелем, умеет осуществлять выбор показателей оценки эффективности управления инвестиционным портфелем, частично владеет навыком разработки и обоснования стратегий управления инвестиционным портфелем с учетом критериев эффективности и рисков</p> <p style="text-align: center;">Хорошо</p> <p>знает подходы и методы оценки</p>

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
		<p style="text-align: center;">Хорошо</p> <p>эффективности и рисков управления инвестиционным портфелем, умеет осуществлять выбор показателей оценки эффективности управления инвестиционным портфелем, не в полной мере владеет навыком разработки и обоснования стратегий управления инвестиционным портфелем с учетом критериев эффективности и рисков</p> <p style="text-align: center;">Отлично</p> <p>знает подходы и методы оценки эффективности и рисков управления инвестиционным портфелем, умеет осуществлять выбор показателей оценки эффективности управления инвестиционным портфелем, в полной мере владеет навыком разработки и обоснования стратегий управления инвестиционным портфелем с учетом критериев эффективности и рисков</p>
<p>ПК.12 владеет методами оценки и управления проектами и готов к их реализации</p>	<p>знать теоретические основы оценки эффективности и управления инвестиционным портфелем, уметь обосновать структуру модельного портфеля, владеть навыками оценки эффективности и риска инвестиционного портфеля</p>	<p style="text-align: center;">Неудовлетворител</p> <p>частично знает теоретические основы оценки эффективности и управления инвестиционным портфелем, не умеет обосновать структуру модельного портфеля, не владеет навыками оценки эффективности и риска инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Удовлетворительн</p> <p>частично знает теоретические основы оценки эффективности и управления инвестиционным портфелем, частично умеет обосновать структуру модельного портфеля, частично владеет навыками оценки эффективности и риска инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Хорошо</p> <p>знает теоретические основы оценки эффективности и управления инвестиционным портфелем, умеет обосновать структуру модельного портфеля, не в полной мере владеет навыками оценки эффективности и риска инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Отлично</p> <p>знает теоретические основы оценки</p>

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
		<p style="text-align: center;">Отлично</p> <p>эффективности и управления инвестиционным портфелем, умеет обосновать структуру модельного портфеля, в полной мере владеет навыками оценки эффективности и риска инвестиционного портфеля</p>
<p>ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта</p>	<p>знать основы управления инвестиционным портфелем, уметь планировать работы по формированию, управлению и оценке эффективности управления инвестиционного портфеля, владеть навыком формирования инвестиционного портфеля</p>	<p style="text-align: center;">Неудовлетворител</p> <p>знает основы управления инвестиционным портфелем, не умеет планировать работы по формированию, управлению и оценке эффективности управления инвестиционного портфеля, не владеет навыком формирования инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Удовлетворительн</p> <p>знает основы управления инвестиционным портфелем, частично умеет планировать работы по формированию, управлению и оценке эффективности управления инвестиционного портфеля, частично владеет навыком формирования инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Хорошо</p> <p>знает основы управления инвестиционным портфелем, умеет планировать работы по формированию, управлению и оценке эффективности управления инвестиционного портфеля, не в полной мере владеет навыком формирования инвестиционного портфеля</p> <p style="text-align: center;">Отлично</p> <p>знает основы управления инвестиционным портфелем, умеет планировать работы по формированию, управлению и оценке эффективности управления инвестиционного портфеля, в полной мере владеет навыком формирования инвестиционного портфеля</p>
<p>ПК.17 способность выполнять операции и использовать различные инструменты и технологии в банковской деятельности</p>	<p>знать операции институциональных инвесторов на рынке ценных бумаг, уметь осуществлять обоснованный выбор инструментов и технологий управления инвестиционным портфелем институционального инвестора с учетом требований</p>	<p style="text-align: center;">Неудовлетворител</p> <p>знает отдельные операции институциональных инвесторов на рынке ценных бумаг, не умеет осуществлять обоснованный выбор инструментов и технологий управления инвестиционным портфелем институционального инвестора с учетом требований законодательства, не владеет навыком применения выбранных</p>

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
	законодательства, владеть навыком применения выбранных инструментов и технологий	<p>Неудовлетворител инструментов и технологий</p> <p>Удовлетворительн знает отдельные операции институциональных инвесторов на рынке ценных бумаг, умеет осуществлять обоснованный выбор инструментов и технологий управления инвестиционным портфелем институционального инвестора с учетом требований законодательства, частично владеет навыком применения выбранных инструментов и технологий</p> <p>Хорошо знает операции институциональных инвесторов на рынке ценных бумаг, умеет осуществлять обоснованный выбор инструментов и технологий управления инвестиционным портфелем институционального инвестора с учетом требований законодательства, не в полной мере владеет навыком применения выбранных инструментов и технологий</p> <p>Отлично знает операции институциональных инвесторов на рынке ценных бумаг, умеет осуществлять обоснованный выбор инструментов и технологий управления инвестиционным портфелем институционального инвестора с учетом требований законодательства, в полной мере владеет навыком применения выбранных инструментов и технологий</p>

Оценочные средства текущего контроля и промежуточной аттестации

Схема доставки : СУОС

Вид мероприятия промежуточной аттестации : Зачет

Способ проведения мероприятия промежуточной аттестации : Оценка по дисциплине в рамках промежуточной аттестации определяется на основе баллов, набранных обучающимся на контрольных мероприятиях, проводимых в течение учебного периода.

Максимальное количество баллов : 100

Конвертация баллов в отметки

«отлично» - от 81 до 100

«хорошо» - от 61 до 80

«удовлетворительно» - от 44 до 60

«неудовлетворительно» / «незачтено» менее 44 балла

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
Входной контроль	Входной контроль Входное тестирование	Понятийный и математический аппарат по предшествующим дисциплинам экономического и финансового профиля.
ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта ПК.10 способность использовать для решения управленческих задач современные технические средства и информационные технологии ПК.12 владеет методами оценки и управления проектами и готов к их реализации	2. Создание инвестиционной декларации модельного инвестиционного портфеля Письменное контрольное мероприятие	Классическая портфельная теория. Модель оценки финансовых активов (САРМ). Модификации САРМ. Модель У. Шарпа. Коэффициент детерминации. Определение уравнения линии характеристики и коэффициента детерминации. Определение набора эффективных портфелей. Прогнозирование величины бета.

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
<p>ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта</p> <p>ПК.12 владеет методами оценки и управления проектами и готов к их реализации</p> <p>ПК.17 способность выполнять операции и использовать различные инструменты и технологии в банковской деятельности</p>	<p>3. Определение стратегий управления модельным инвестиционным портфелем</p> <p>Письменное контрольное мероприятие</p>	<p>Доходность и риск инвестиционного инструмента. Ликвидность. Доходность и риск инвестиционного портфеля. Пассивные и активные стратегии. Механические стратегии по размещению средств по классам активов. Активные и пассивные стратегии.</p>
<p>ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта</p> <p>ПК.11 способность критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий</p> <p>ПК.17 способность выполнять операции и использовать различные инструменты и технологии в банковской деятельности</p>	<p>4. Создание модельного инвестиционного портфеля</p> <p>Письменное контрольное мероприятие</p>	<p>Подходы к формированию портфеля. Моделирование краткосрочного спекулятивного портфеля. Хеджирование инвестиционного портфеля. Оценка эффективности управления портфелем. Показатели эффективности управления портфелем. Показатели способности менеджера прогнозировать доходности активов и конъюнктуру. Омега. Разложение доходности на составляющие компоненты.</p>

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
<p>ПК.9 способность организовывать работы по реализации конкретного экономического проекта</p> <p>ПК.10 способность использовать для решения управленческих задач современные технические средства и информационные технологии</p> <p>ПК.11 способность критически оценивать предлагаемые варианты управленческих решений, разрабатывать и обосновывать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий</p> <p>ПК.12 владеет методами оценки и управления проектами и готов к их реализации</p> <p>ПК.17 способность выполнять операции и использовать различные инструменты и технологии в банковской деятельности</p>	<p>Комплексный итоговый контроль</p> <p>Итоговое контрольное мероприятие</p>	<p>Теория и методология управления инвестиционным портфелем. Формирование, организация управления, оценка качества управления инвестиционного портфеля.</p>

Спецификация мероприятий текущего контроля

Входной контроль

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **1 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **0**

Проходной балл: **0**

Показатели оценивания	Баллы
1 вопрос - 1 балл	10

2. Создание инвестиционной декларации модельного инвестиционного портфеля

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**
Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**
Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**
Проходной балл: **9**

Показатели оценивания	Баллы
1 вопрос - 1 балл	20

3. Определение стратегий управления модельным инвестиционным портфелем

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**
Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**
Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**
Проходной балл: **9**

Показатели оценивания	Баллы
1 задача - 2 балла	20

4. Создание модельного инвестиционного портфеля

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **.5 часа**
Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**
Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**
Проходной балл: **9**

Показатели оценивания	Баллы
1 вопрос - 1 балл	20

Комплексный итоговый контроль

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**
Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**
Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **40**
Проходной балл: **17**

Показатели оценивания	Баллы
1 задача - 2 балла	40