

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Наумова Наталия Александровна
Должность: Ректор
Дата подписания: 24.10.2024 14:21:41
Уникальный программный ключ:
6b5279da4e034bff679172803da5b7b559fc69e2

МИНИСТЕРСТВО ПРОСВЕЩЕНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
«ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРОСВЕЩЕНИЯ»
(ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРОСВЕЩЕНИЯ)
Экономический факультет
Кафедра финансово-экономического и бизнес-образования

УТВЕРЖДЕН

на заседании кафедры

протокол от «11» марта 2024 г., №8.

Заведующий кафедрой _____ / Т.И. Власова /

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

По учебной дисциплине
Управление фондовым портфелем

Направление подготовки
38.03.01 Экономика

Профиль:
Финансы и кредит

Квалификация
Бакалавр

Формы обучения
Очная

Мытищи
2024

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения ОПВО

Код и наименование компетенции	Этапы формирования
СПК-1. Способен собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета финансово-экономических показателей, характеризующих деятельность предприятия.	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа
СПК-2. Способен выполнять необходимые финансово-экономические расчеты, обосновывать их и представлять результаты в соответствии с принятыми в организации стандартами.	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа
ДПК-3. Способен оценивать финансово-экономические показатели, отражающие специфику функционирования финансово-кредитной сферы.	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Оцениваемые компетенции	Уровень сформированности	Этап формирования	Описание показателей	Критерии оценивания	Шкала оценивания
СПК-1	Пороговый	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа	Знать: -процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; -возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ: Уметь: -определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; -соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы	Устный опрос	Шкала оценивания устного опроса

	Продвинутый	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа	статистической обработки Знать: -процесс сбора финансово-экономической, статистической и бухгалтерской информации; -возможность обработки собранной информации при помощи информационных технологий и различных финансово-бухгалтерских программ: Уметь: -определять ценность сбора, анализа и обработки собранной финансово-экономической информации; -соотносить собираемость информации на определенную дату и проводя анализ данных использовать различные методы статистической обработки; Владеть: -навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для определения места профессиональной деятельности в экономической парадигме; -приемами анализа сложных социально-экономических показателей; -навыками составления пояснения и объяснения изменения показателей, после проведенного сбора и анализа данных.	Реферат Устный опрос	Шкала оценивания устного опроса Шкала оценивания реферата
СПК-2	Пороговый	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостоятельная работа	Знать: - нормативно-правовую документацию регламентирующую, требования к проведению финансово-экономических расчетов; - основные финансово-экономические показатели и методику их подсчета: Уметь: выполнять необходимые расчеты	Устный опрос	Шкала оценивания устного опроса
	Продвинут	1.Работа на	Знать:		Шкала

	ый	учебных занятиях 2.Самостояте льная работа	требования к проведению финансово-экономических расчетов в рамках действующих экономических и финансовых планов; Уметь: анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты в соответствии с принятыми в организации стандартами Владеть: методами и приемами расчета и анализа показателей в рамках экономического и финансового планирования в соответствии с принятыми в организации стандартами, а также международными стандартами финансовой отчетности	Реферат Устный опрос	оценивания устного опроса Шкала оценивания реферата
ДПК-3	Пороговый	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостояте льная работа	Знать: - варианты финансово- экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности. Уметь: -анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста	Устный опрос	Шкала оценивания устного опроса
	Продвинут ый	1.Работа на учебных занятиях 2.Самостояте льная работа	Знать: - варианты финансово- экономического анализа при решении вопросов профессиональной деятельности. Уметь: анализировать многообразие собранных данных и приводить их к определенному результату для обоснования экономического роста; - оценивать роль собранных данных для расчета каждого экономического показателя. Владеть:	Реферат Устный опрос	Шкала оценивания устного опроса Шкала оценивания реферата

			-методами анализа финансово-экономических показателей, отражающих специфику функционирования финансово-кредитной сферы - навыками построения финансовых моделей в рамках текущей и инвестиционной деятельности		
--	--	--	--	--	--

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Примерные темы рефератов

1. Рынок ценных бумаг в Российской Федерации, характерные черты и современное состояние
2. Профессионалы рынка ценных бумаг и их деятельность
3. Участники рынка ценных бумаг, их классификация, роль в экономике страны
4. Фондовая биржа - главный институт рынка ценных бумаг. Виды, структура и управление фондовыми биржами
5. Внебиржевой рынок ценных бумаг, его особенности в РФ
6. Коммерческие банки на рынке ценных бумаг.
7. Государственное регулирование рынка ценных бумаг
8. Механизм торговли ценными бумагами
9. Ассоциация профессионалов на рынке ценных бумаг
10. Портфель ценных бумаг и оптимизация его структуры
11. Принципы управления портфельными инвестициями
12. Эмиссия корпоративных ценных бумаг
13. Проектирование параметров облигаций
14. Политика инвестирования средств предприятия в финансовые активы
15. Методы оценки эффективности инвестиций в финансовые активы
16. Схемы выпуска и размещения инвестиционных паев в инвестиционных фондах
17. Предприятие как эмитент на рынке ценных бумаг
18. Виды портфельного инвестирования
19. Портфель ценных бумаг
20. Оценка инвестиционных параметров портфеля ценных бумаг
21. Характеристика фондовых инвесторов

Примерные темы для устного опроса

1. Безрисковый портфель ценных бумаг.
2. Диверсификация портфеля ценных бумаг.
3. Доходность и риски.
4. Доходность индекса рынка.
5. Задачи и функции инвестиционной деятельности на фондовом рынке.
6. Игра на повышение и игра на понижение.

7. Концепции риска в портфельном инвестировании.
8. Концепция доходности в портфельном инвестировании.
9. Методы управления инвестиционными рисками.
10. Модели управления портфелем.
11. Модели ценообразования активов.
12. Модель оптимального портфеля при возможности заимствования и одалживания.
13. Мониторинг фондового портфеля.
14. Основы определения инвестиционного риска.
15. Особенности регулирования и надзора на фондовом рынке.
16. Особенности финансовых инвестиций.
17. Оценка эффективности управления портфелем
18. Повышение доходности портфеля.
19. Портфель Марковица
20. Портфель Тобина.
21. Портфель ценных бумаг.
22. Применение моделей стоимости опционов в управлении финансами фирмы
23. Принципы формирования портфеля ценных бумаг.
24. Самофинансируемый портфель ценных бумаг.
25. Структура инвестиций и их виды.
26. Упрощенные методы нахождения эффективных портфелей.
27. Формирование оптимального портфеля ценных бумаг.

Примерные вопросы для зачета

1. . Фондовый рынок как часть финансового рынка
2. Понятие «фондовые ценности»
3. Виды и сущность ценных бумаг
4. Классификация ценных бумаг
5. Инвестиционные качества ценных бумаг
6. Эмиссия ценных бумаг
7. Акционерное общество как эмитент фондовых ценностей
8. Производные ценные бумаги
9. Операции с ценными бумагами
10. Понятие «Рынок ценных бумаг»
11. Структура рынка ценных бумаг
12. Участники рынка ценных бумаг
13. Регламентация деятельности на рынке ценных бумаг.
14. Доходность по ценным бумагам
15. Посредники на фондовом рынке
16. Понятие «фондовый портфель»
17. Портфель ценных бумаг
18. Деятельность портфельного инвестора
19. Цели формирования фондового портфеля
20. Доходность фондового портфеля
21. Ликвидность портфеля ценных бумаг
22. Прирост фондового портфеля
23. Риск фондового портфеля
24. Состав портфельного риска
25. Минимизация риска портфеля ценных бумаг
26. Типы фондовых портфелей
27. Оптимизация управления портфелем ценных бумаг
28. Структура фондового портфеля

29. Диверсификация портфеля ценных бумаг
30. Неопределенность портфеля ценных бумаг
31. Выбор тактики управления портфелем ценных бумаг
32. Пассивное управление фондовым портфелем
33. Активное управление фондовым портфелем
34. Процесс принятия решения фондовым менеджером
35. Модель фондового портфеля
36. Метод пассивного управления фондовым портфелем
37. Метод активного управления фондовым портфелем
38. Методы управления портфелем ценных бумаг
39. Метод технического анализа ценных бумаг
40. Оценка отраслей народного хозяйства для фундаментального анализа ценных бумаг
41. Виды специальных портфелей ценных бумаг
42. Функциональные риски на фондовом рынке
43. Характеристика консервативных инвесторов
44. Характеристика агрессивных инвесторов
45. Цели отбора ценных бумаг
46. Роль фондового портфеля на рынке ценных бумаг
47. Метод фундаментального анализа ценных бумаг
48. Деятельность менеджера по управлению портфелем ценных бумаг
49. Методы отбора ценных бумаг

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

Основными формами текущего контроля являются реферат, устный опрос.

Максимальное количество баллов, которое может набрать студент в течение семестра за различные виды работ – 80 баллов.

Максимальная сумма баллов, которые может получить студент на зачете – 20 баллов.

Максимальная сумма баллов студентов по изучаемой дисциплине составляет 100 баллов.

Шкала оценивания реферата

За семестр предусмотрено 2 реферата – 50 баллов.

Критерии оценивания	Баллы
Содержание соответствуют поставленным цели и задачам, изложение материала отличается логичностью и смысловой завершенностью, студент показал владение материалом, умение четко, аргументировано и корректно отвечает на поставленные вопросы, отстаивать собственную точку зрения	25
Содержание недостаточно полно соответствует поставленным цели и задачам исследования, работа выполнена на недостаточно широкой источниковой базе и не учитывает новейшие достижения науки, изложение материала носит преимущественно описательный характер, студент показал достаточно уверенное владение материалом, однако недостаточное умение четко, аргументировано и корректно отвечать на поставленные вопросы и отстаивать собственную точку зрения	15
Содержание не отражает особенности проблематики избранной темы; содержание работы не полностью соответствует поставленным задачам, источниковая база является фрагментарной и не позволяет качественно решить все поставленные в работе задачи, работа не учитывает новейшие	5

достижения историографии темы, студент показал неуверенное владение материалом, неумение отстаивать собственную позицию и отвечать на вопросы	
Работа не имеет логичной структуры, содержание работы в основном не соответствует теме, источниковая база исследования является недостаточной для решения поставленных задач, студент показал неуверенное владение материалом, неумение формулировать собственную позицию.	0

Шкала оценивания устного опроса

За семестр предусмотрено 3 опроса – 30 баллов.

Критерии оценивания	Баллы
высокая активность на практических занятиях, содержание и изложение материала отличается логичностью и смысловой завершенностью, студент показал владение материалом, умение четко, аргументировано и корректно отвечает на поставленные вопросы, отстаивать собственную точку зрения.	10
участие в работе на практических занятиях, изложение материала носит преимущественно описательный характер, студент показал достаточно уверенное владение материалом, однако недостаточное умение четко, аргументировано и корректно отвечает на поставленные вопросы и отстаивать собственную точку зрения.	5
низкая активность на практических занятиях, студент показал неуверенное владение материалом, неумение отстаивать собственную позицию и отвечать на вопросы.	2
отсутствие активности на практических занятиях, студент показал незнание материала по содержанию дисциплины.	0

Шкала оценивания зачета

Критерии оценивания	Интервал оценивания
студент быстро и самостоятельно готовится к ответу; при ответе полностью раскрывает сущность поставленного вопроса; способен проиллюстрировать свой ответ конкретными примерами; демонстрирует понимание проблемы и высокий уровень ориентировки в ней; формулирует свой ответ самостоятельно, используя лист с письменным вариантом ответа лишь как опору, структурирующую ход рассуждения	20
студент самостоятельно готовится к ответу; при ответе раскрывает основную сущность поставленного вопроса; демонстрирует понимание проблемы и достаточный уровень ориентировки в ней, при этом затрудняется в приведении конкретных примеров.	10
студент готовится к ответу, прибегая к некоторой помощи; при ответе не в полном объеме раскрывает сущность поставленного вопроса, однако, при этом, демонстрирует понимание проблемы.	5
студент испытывает выраженные затруднения при подготовке к ответу, пытается воспользоваться недопустимыми видами помощи; при ответе не раскрывает сущность поставленного вопроса; не ориентируется в рассматриваемой проблеме; оказываемая стимулирующая помощь и задаваемые уточняющие вопросы не способствуют более	0

продуктивному ответу студента.	
--------------------------------	--

Итоговая шкала оценивания результатов освоения дисциплины

Итоговая оценка по дисциплине выставляется по приведенной ниже шкале. При выставлении итоговой оценки преподавателем учитывается работа обучающегося в течение освоения дисциплины, а также оценка по промежуточной аттестации.

Баллы, полученные студентом по текущему контролю и промежуточной аттестации	Оценка в традиционной системе
41 - 100	Зачтено
0 - 40	Не зачтено