

ЧАСТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«СОЦИАЛЬНО-ПЕДАГОГИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ»

Кафедра Естественных и социально-экономических дисциплин



УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УВР
П.Ф.Зубайлова
« 29 » май 2023 г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

По дисциплине ФТД.02
«Управление фондовым портфелем»

Направление подготовки
38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) программы бакалавриата:
Бухгалтерский учет, анализ и аудит

Квалификация (степень)
Бакалавр

Форма обучения
Очная

Дербент
2023

Организация-разработчик: Частное образовательное учреждение высшего образования «Социально-педагогический институт» (ЧОУ ВО «СПИ»)

Разработчик:

Ст.преп. кафедры ЕСЭд Устаров И.У.
(занимаемая должность) (степ., инициалы, фамилия)

Одобрено на заседании кафедры

Естественных и социально-экономических дисциплин

26 мая 2023 г., протокол № 11

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Гамидов Г.Г.

АННОТАЦИЯ

Фонд оценочных средств составлен на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки **38.03.01 Экономика**.

ФОС предназначен для текущего и промежуточного контроля знаний студентов, обучающихся направленность (профиль) программы бакалавриата: Бухгалтерский учет, анализ и аудит.

ФОС состоит из:

1. Перечень компетенций (или их индикаторов) с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы;
2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания;
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;
4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

С фондом оценочных средств можно ознакомиться на сайте ЧОУ ВО «Социально-педагогический институт» www.spi-vuz.ru

Фонды оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся.

1. Перечень компетенций (или их индикаторов) с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

ОПК-4 Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности

ОПК-4.1 Определяет финансово-экономические цели деятельности организации (предприятия) и формирует на их основе перечни задач, которые могут решаться инструментами экономического анализа

ОПК-4.2 Оценивает последствия альтернативных вариантов решения поставленных профессиональных задач; разрабатывает и обосновывает варианты их решения с учётом критериев экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий

ОПК-4.3 Прогнозирует ответное поведение других заинтересованных сторон/участников стратегического взаимодействия (конкурентов, партнёров, подчиненных и др.) на принимаемые организационно-управленческие решения

ПК-1 Способен выполнять аудиторские задания и прочие услуги, связанные с аудиторской деятельностью

ПК-1.1 - Планирует работу участников аудиторской группы

ПК-1.2 - Организует работу участников аудиторской группы

ПК-1.3 - Контролирует работу участников аудиторской группы

№	Разделы	Контролируемые компетенции (или их индикаторы)	Оценочные средства
1	Выбор инвестиционной политики	ОПК-4.1; ОПК-4.2; ОПК-4.3; ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3	Опрос Тестирование Реферат Контрольная работа
2	Процесс формирования портфеля ценных бумаг	ОПК-4.1; ОПК-4.2; ОПК-4.3; ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3	Опрос Тестирование Реферат Контрольная работа

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

3.

№	Аббревиатура компетенции	Поведенческий индикатор	Оценочные средства
	ОПК-4.1; ОПК-4.2; ОПК-4.3; ПК-1.1; ПК-1.2; ПК-1.3	Уровень знаний основные этапы процесса управления инвестиционным портфелем; основные математические модели, используемые в управлении портфелем, а также их фундаментальные ограничения и распространённые ошибки в	Опрос Тестирование Реферат Контрольная работа

		<p>их использовании.</p> <p>Уровень умений формулировать инвестиционную политику и принимать решение об аллокации активов; разрабатывать стратегии для управления, мониторинга и ребалансировки инвестиционного портфеля; оценивать результативность инвестиционного портфеля; писать консалтинговые заключения и рекомендации.</p> <p>Уровень навыков Иметь навыки (приобрести опыт): находить в бытовых ситуациях задачи, которые можно формализовать и решить при помощи полученных знаний и умений; представлять ответ в форме, понятной не специалисту.</p>	
--	--	--	--

Описание шкалы оценивания

На зачет

№	Оценивание	Требования к знаниям
1	Зачтено	Компетенции освоены
2	Не зачтено	Компетенции не освоены

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.

Примерная тематика тем для контрольной работы.

1. Виды специальных портфелей ценных бумаг.
2. Функциональные риски на фондовом рынке.
3. Характеристика консервативных инвесторов.
4. Характеристика агрессивных инвесторов.
5. Цели отбора ценных бумаг.
6. Роль фондового портфеля на рынке ценных бумаг.
7. Метод фундаментального анализа ценных бумаг.
8. Деятельность менеджера по управлению портфелем ценных бумаг.
9. Методы отбора ценных бумаг.
10. Характеристика фондовых инвесторов.

Примерная тематика рефератов

1. Государственное регулирование рынка ценных бумаг
2. Механизм торговли ценными бумагами
3. Ассоциация профессионалов на рынке ценных бумаг
4. Портфель ценных бумаг и оптимизация его структуры
5. Принципы управления портфельными инвестициями
6. Эмиссия корпоративных ценных бумаг
7. Проектирование параметров облигаций
8. Политика инвестирования средств предприятия в финансовые активы

9. Методы оценки эффективности инвестиций в финансовые активы
10. Схемы выпуска и размещения инвестиционных паев в инвестиционных фондах
11. Предприятие как эмитент на рынке ценных бумаг
12. Виды портфельного инвестирования
13. Управление портфелем ценных бумаг
14. Оценка инвестиционных параметров портфеля ценных бумаг

Примерная тематика тем для устного опроса

1. Понятие портфеля ценных бумаг.
2. Характеристики инвестиционного портфеля.
3. Объекты портфельного инвестирования.
4. Цели портфельного инвестирования.
5. Классификации инвестиционных портфелей
6. Виды инвестиционных портфелей.
7. Стратегии формирования и управления портфелем ЦБ
8. Основные принципы управления портфелем ценных бумаг
9. Метод пассивного управления фондовым портфелем
10. Метод активного управления фондовым портфелем
11. Существование множества эффективных портфелей и их нахождение.
12. Понятие кредитного и заемного портфелей.
13. Эффективная граница портфелей состоящих из рисковых и безрисковых активов.
14. Оценка доходности портфеля за период
15. Оценка внутренней доходности портфеля
16. Оценка доходности портфеля на основе средней геометрической
17. Коэффициент Шарпа.
18. Коэффициент Трейнора
19. Коэффициент эффективности портфеля облигаций
20. Оценка портфелей на основе значения альфы.

Тесты

Примерный вариант тестовых заданий для текущего, промежуточного и

1. Рынок ценных бумаг представляет собой:
 - а) место, где продаются и покупаются ценные бумаги (фондовые инструменты);
 - б) совокупность экономических отношений, возникающих в процессе выпуска (эмиссии), обращения на вторичном рынке и погашения ценных бумаг, позволяющих мобилизовать капитал для инвестиций в экономику;
 - в) систему уполномоченных банков, осуществляющих операции с ценными бумагами;
 - г) финансовый инструмент мобилизации денежных средств.
 Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.
2. На первичном рынке ценных бумаг происходит:
 - а) размещение ценных бумаг;
 - б) мобилизация финансовых ресурсов;
 - в) перепродажа ценных бумаг;
 - г) перераспределение финансовых ресурсов.
 Варианты ответов: 1) а, б; 2) а, г; 3) б, в; 4) б, г.
3. К специфическим функциям рынка ценных бумаг относятся: а) коммерческая, обеспечивающая получение прибыли от операций по купле-продаже ценных бумаг; б) ценовая, обеспечивающая процесс формирования цен на рынке;

в) информационная;
г) регулирующая, обеспечивающая перевод сбережений из непроизводственной сферы в производственную;

д) страхования ценовых и финансовых рисков;

е) перераспределения денежных средств между отраслями и сферами экономики.

Варианты ответов: 1) а, б; 2) б, в; 3) в, г; 4) д, е.

4. Как осуществляется передача прав удостоверенных именной ценной бумагой:

а) вручением ценной бумаги;

б) путем индоссамента;

в) путем цессии;

г) оформлением нотариально заверенного договора купли продажи.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

5. Выписки иностранных ценных бумаг, допущенные к обращению на территории Российской Федерации, регистрируются:

а) Центральным банком РФ;

б) Министерством финансов РФ; в) ФКЦБ;

г) фондовой биржей.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

6. Вексель является эмиссионной ценной бумагой:

а) да;

б) нет.

Варианты ответов: 1) а, в; 2) б, в; 3) а, г; 4) б, г.

7. Акция является эмиссионной ценной бумагой:

а) да;

б) нет.

8. Облигация является эмиссионной ценной бумагой:

в) да; г) нет.

Варианты ответов: 1) а, в; 2) б, в; 3) а, г; 4) б, г.

9. Варрант представляет собой:

а) преимущественное право на приобретение дополнительных акций нового выпуска;

б) право купить или продать биржевой актив или фьючерсный контракт;

в) обязательство, которое дает продавец покупателю в отношении права собственности на уже обращающиеся ценные бумаги;

г) договор на поставку оговоренного количества ценностей в течение определенного периода времени по цене, установленной на момент сделки.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

10. Какова доля привилегированных акций в общем объеме уставного капитала акционерного общества:

а) не должна превышать 5%;

б) не должна превышать 25%;

в) не должна превышать 50%; г) определяется уставом общества.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

11. Балансовая стоимость акций - это величина активов, приходящихся на одну:

а) акцию;

б) привилегированную акцию;

в) обыкновенную акцию;

г) отзывную акцию.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

12. На цену облигации влияют следующие факторы:

а) уровень процентной ставки;

б) период обращения;

- в) срок до погашения;
 - г) доходность вложений в альтернативный сектор.
- Варианты ответов: 1) а, б, в, г; 2) б, в, г; 3) в, г; 4) г.

13. Кто может быть эмитентом депозитных и сберегательных сертификатов: а) акционерные общества;

- б) Министерство финансов РФ;
- в) унитарные предприятия; г) коммерческие банки.

Варианты ответов: 1) а; 2) б; 3) в; 4) г.

14. Рынок ценных бумаг включает в себя следующие основные составляющие:

- а) товарные ценные бумаги;
- б) денежные ценные бумаги;
- в) основные ценные бумаги;
- г) производные ценные бумаги;
- д) денежные средства.

Варианты ответов: 1) а, б, в, г; 2) а, б, в, г, д; 3) б, в, г, д; 4) а, б, в, д.

15. К общерыночным функциям рынка ценных бумаг относятся следующие функции:

- а) коммерческая, обеспечивающая получение прибыли от операций по куплепродаже ценных бумаг;
- б) ценовая, обеспечивающая процесс формирования цен на рынке; в) информационная;
- г) регулирующая, обеспечивающая перевод сбережений из непроизводственной сферы в производственную;
- д) страхования ценовых и финансовых рисков;
- е) перераспределения денежных средств между отраслями и сферами экономики.

Варианты ответов: 1) а, б, г, д; 2) б, г, д, е; 3) а, б, в, г; 4) б, в, г, д.

16. Законодательством РФ в качестве ценных бумаг принимаются:

- а) акции;
- б) облигации;
- в) векселя;
- г) банковские сертификаты;
- д) банковская сберегательная книжка;
- е) чек;
- ж) коносамент;
- з) приватизационные ценные бумаги;
- и) залладные;
- к) страховые и медицинские полисы.

Варианты ответов: 1) а, б, в, г, д, е, ж, з, и, к; 2) а, б, в, г, д, е, ж, з, и; 3) а, б, в, г, д, е, ж, з; 4) а, б, в, г, д, е, ж.

17. Организация, оказывающая услуги по хранению сертификатов ценных бумаг и учету прав собственности на ценные бумаги - это ...

- а) депозитарий;
- б) регистратор;
- в) клиринговая палата;
- г) биржа

18. При банкротстве акционерного общества, акционер ...

- а) отвечает по обязательствам общества;
- б) должен отдать часть своего имущества
- в) не отвечает по обязательствам общества

Вопросы к зачёту

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. Управление портфелем 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

50. Характеристика фондовых инвесторов

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

Знания, умения, навыки студента на зачете оцениваются: *«зачтено»*, *«не зачтено»*.

Основой для определения оценки служит уровень усвоения студентами материала, предусмотренного данной рабочей программой.

Оценивание студента на зачете по дисциплине

Оценка зачета (стандартная)	Требования к знаниям
«зачтено» («компетенции освоены»)	Оценка «зачтено» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.
«не зачтено» («компетенции не освоены»)	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «не зачтено» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.