

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 23.07.2024 16:35:08

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

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

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Финансов

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины	Б1.В.ДЭ.02.01 Управление портфелем финансовых активов
Основная профессиональная образовательная программа	38.04.08 Финансы и кредит программа Финансовые активы

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Управление портфелем финансовых активов входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений (дисциплина по выбору) блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Управление банковскими активами, Казначейское управление средствами федерального бюджета, Бюджетирование в коммерческих организациях, Бюджетный менеджмент, Правовой механизм госзакупок, Финансовая политика государства и корпораций, Общественные финансы в регионе, Управление проектной деятельностью в профессиональной сфере

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

Изучение дисциплины Управление портфелем финансовых активов в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Универсальные компетенции (УК):

УК-6 - Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	УК-6	УК-6.1: Знать:	УК-6.2: Уметь:
	приоритеты собственной деятельности в организации, способы ее совершенствования на основе самооценки	формировать необходимое информационное обеспечение для аналитического обоснования управленческих решений	методами анализа собственной деятельности в организации и способами ее совершенствования на основе самооценки

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен оптимизировать финансовый план

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-3	ПК-3.1: Знать:	ПК-3.2: Уметь:
	методы оптимизации финансового плана	применять методы оптимизации финансового плана	приемами критического анализа результатов оптимизации финансового плана

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 4
Контактная работа, в том числе:	16.15/0.45
Занятия семинарского типа	16/0.44

Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	73.85/2.05
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Управление портфелем финансовых активов представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа			Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Занятия семинарского типа		ИКР		
		Практич. занятия	ГКР			
1.	Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	8			37.85	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
2.	Методы оптимизации портфеля финансовых активов	8			36.00	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3
	Контроль	18				
	Итого	16	0.15		73.85	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	практическое занятие	Понятие, состав и структура финансовых активов
		практическое занятие	Состав и особенности портфеля финансовых активов, включаемых в инвестиционный портфель
2.	Методы оптимизации портфеля финансовых активов	практическое занятие	Содержание процесса управления активами предприятия
		практическое занятие	Управление использованием активов в инвестиционном процессе предприятия

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств

(включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	- подготовка доклада - подготовка эссе - подготовка аналитической записки - подготовка практической задачи
2.	Методы оптимизации портфеля финансовых активов	- подготовка доклада - подготовка эссе - подготовка аналитической записки

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

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

Алехин, Б. И. Рынок ценных бумаг : учебник и практикум для вузов / Б. И. Алехин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 497 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05683-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/538065>

Дополнительная литература

Вавилов, С. А. Финансовая математика. Стохастический анализ : учебник и практикум для вузов / С. А. Вавилов, К. Ю. Ермоленко. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 244 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02650-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536772>

Литература для самостоятельного изучения

- Афоничкин, А. И. Финансовый менеджмент в 2 ч. Часть 1. Методология : учебник и практикум для вузов / А. И. Афоничкин, Л. И. Журова, Д. Г. Михаленко ; под редакцией А. И. Афоничкина. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 217 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04394-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/514462>
- Афоничкин, А. И. Финансовый менеджмент в 2 ч. Часть 2. Финансовая политика предприятия : учебник и практикум для вузов / А. И. Афоничкин, Л. И. Журова, Д. Г. Михаленко ; под редакцией А. И. Афоничкина. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 297 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04396-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/514954>
- Трофимова, Л. А. Методы принятия управленческих решений : учебник и практикум для вузов / Л. А. Трофимова, В. В. Трофимов. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 335 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-01584-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510561>
- Управление проектами : учебник и практикум для вузов / А. И. Балашов, Е. М. Рогова, М. В. Тихонова, Е. А. Ткаченко ; под общей редакцией Е. М. Роговой. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 383 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00436-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510590>
- Поляков, Н. А. Управление инновационными проектами : учебник и практикум для вузов / Н. А. Поляков, О. В. Мотовилов, Н. В. Лукашов. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт,

2023. — 384 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15534-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511434>
6. Финансовый анализ : учебник и практикум для вузов / И. Ю. Евстафьева [и др.] ; под общей редакцией И. Ю. Евстафьевой, В. А. Черненко. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 337 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00627-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511414>
7. Казакова, Н. А. Финансовый анализ в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 209 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08793-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/494714>
8. Казакова, Н. А. Финансовый анализ в 2 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / Н. А. Казакова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 297 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08792-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/494713>
9. 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>
10. Холодкова, В. В. Управление инвестиционным проектом : учебник и практикум для вузов / В. В. Холодкова. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 302 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07049-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/516169>
11. Леонтьев, В. Е. Корпоративные финансы : учебник для вузов / В. Е. Леонтьев, В. В. Бочаров, Н. П. Радковская. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 354 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04842-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510949>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
---	---

Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Управление портфелем финансовых активов:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком «+»
Текущий контроль	Оценка доклада	+
	Оценка эссе	+
	Оценка аналитической записки	+
	Оценка практической задачи	+
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

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

Универсальные компетенции (УК):

УК-6 - Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее

совершенствования на основе самооценки

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
		УК-6.1: Знать:	УК-6.2: Уметь:
	приоритеты собственной деятельности в организации, способы ее совершенствования на основе самооценки	формировать необходимое информационное обеспечение для аналитического обоснования управленческих решений	методами анализа собственной деятельности в организации и способами ее совершенствования на основе самооценки
Пороговый	Знать: приоритеты собственной деятельности в организации	Уметь: вырабатывать управленческие решения	Владеть: методами анализа в профессиональной сфере
Стандартный (в дополнение к пороговому)	Знать: место и роль самооценки для реализации приоритетов собственной деятельности в организации	Уметь: формировать информационное обеспечение для управленческих решений	Владеть: методами оценки собственной деятельности в организации на основе самооценки
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	Знать: инструменты и методы для реализации приоритетов в собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки	Уметь: формировать необходимое информационное обеспечение для управленческих решений в деятельности организации	Владеть: методами анализа собственной деятельности в организации и способами ее совершенствования на основе самооценки

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-3 - Способен оптимизировать финансовый план

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
		ПК-3.1: Знать:	ПК-3.2: Уметь:
	методы оптимизации финансового плана	применять методы оптимизации финансового плана	приемами критического анализа результатов оптимизации финансового плана
Пороговый	Знать: теоретические основы финансового планирования	Уметь: составлять финансовые планы	Владеть: навыками анализа результатов оптимизации финансового плана
Стандартный (в дополнение к пороговому)	Знать: сущность оптимизации в финансовом планировании	Уметь: обосновывать необходимость оптимизации финансовывых планов	Владеть: приемами обоснования необходимости оптимизации финансовывых планов

Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	Знать: современные методы оптимизации финансовых планов	Уметь: применять современные методы оптимизации финансовых планов	Владеть: современными методами оптимизации финансовых планов
--	--	--	---

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	УК-6.1, УК-6.2, УК- 6.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Оценка доклада; Оценка эссе; Оценка аналитической записки; Оценка практической задачи	зачет
2.	Методы оптимизации портфеля финансовых активов	УК-6.1, УК-6.2, УК- 6.3, ПК-3.1, ПК-3.2, ПК-3.3	Оценка доклада; Оценка эссе; Оценка аналитической записки; Оценка практической задачи	зачет

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	<ol style="list-style-type: none"> 1. Управление денежными средствами 2. Вложения в обыкновенные акции 3. Вложения в привилегированные акции 4. Вложения в облигации с купонным доходом 5. Вложения в бескупонные облигации 6. Хеджирование опционами 7. Оценка опционов 8. Инструменты коммерческого кредита 9. Влияние рисков на оценку стоимости долговых ценных бумаг 10. Влияние рисков на оценку долевых ценных бумаг 11. Хеджирование опционами 12. Фьючерсы: сущность, применение 13. Свопы: сущность, виды, применение
Методы оптимизации портфеля финансовых активов	<ol style="list-style-type: none"> 1. Модели оценки привилегированных акций. 2. Теория ожиданий. 3. Теория предпочтения ликвидности. 4. Рейтинг облигаций. 5. Инструменты коммерческого кредита. 6. Создание резервов под обесценение задолженности.

Примерная тематика эссе

Раздел дисциплины	Вопросы
-------------------	---------

Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	1. Вложения в акции и долевое участие в организациях. 2. Опционные стратегии. Оценка стоимости опционов.
Методы оптимизации портфеля финансовых активов	1. Вложения в облигации и прочие обязательства. 2. Управление опционами.

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций

Акция – это:

- не эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов
- эмиссионная ценная бумага, закрепляющая право ее владельца на получение от эмитента в предусмотренный в ней срок ее номинальной стоимости
- +эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права ее владельца на получение части прибыли акционерного общества в виде дивидендов на участие управлением акционерного общества и на часть имущества остающегося после его ликвидации

Ценные бумаги не классифицируются по следующим критериям:

- эмитентам
- срокам функционирования
- +стоимости ценных бумаг
- по экономической природе

По виду выраженных прав ценные бумаги делятся на:

- привилегированные и непривилегированные
- денежные и безденежные
- +долговые и долевые
- эмиссионные и неэмиссионные

Эмиссионная ценная бумага, закрепляющая права её владельца на получение части прибыли в виде дивидендов – это:

- облигация
- опцион эмитента
- казначейские обязательства
- +акция

Плата за использование заемных средств - это

- +проценты
- купонный доход
- дисконт
- дивиденды

Владельцы каких ценных бумаг не имеют право голосовать на общем собрании акционеров:

- +владельцы обыкновенных акций
- владельцы краткосрочных акций
- владельцы привилегированных акций

Цена продажи акции при первичном размещении – это:

- дисконтная цена
- +эмиссионная цена
- номинальная цена
- рыночная цена

Рынок ценных бумаг – это:

- совокупность сделок, связанных с покупкой и продажей валюты

- +совокупность сделок с ценными бумагами
- сделки с недвижимостью

Главная задача рынка ценных бумаг – это:

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

Организованный рынок ценных бумаг осуществляется

- государством
- +биржей
- акциями

Рынок, на котором исполнение заключенных сделок происходит не позднее второго рабочего дня со дня заключения сделки, называется:

- срочный рынок
- +кассовый рынок
- организованный внебиржевой рынок

Ничем не обусловленное обязательство векселедателя выплатить по наступлении предусмотренного срока полученную займы сумму...

- сберегательный сертификат
- +простой вексель
- переводной вексель
- облигация

Именная ценная бумага, подтверждающая право её владельца на долю в имуществе фонда - это

- акция
- облигация
- +инвестиционный пай

Товары полностью или частично продаваемые через биржи относятся к:

- +биржевым
- оптовым
- розничным

Как называется торговое соглашение, согласно которому продавец поставляет конкретную продукцию покупателю к определенному сроку в будущем?

- +форвардный контракт
- торговый контракт
- реальный контракт

Цена, характеризующая выражение стоимости чего-либо, поставляемого в будущем, называется:

- +форвардной
- прогнозной
- стандартной

Как называется организованный форум для заключения срочных контрактов, которые для большей ликвидности имеют в высшей степени стандартизованные условия?

- торговые рынки
- +фьючерсные рынки
- биржевые рынки

В чем состоят функции регистрационного бюро на бирже?

- регистрировать участников биржи
- регистрировать нарушения на бирже
- +фиксировать совершаемые сделки и давать информацию на табло

На первичном рынке ценных бумаг происходит:

- государственные финансовые органы выставляют на продажу ценные бумаги
- формируется идея об эмиссии ценных бумаг и рассчитывается их первичная стоимость
- + эмитентом выпускаются и продаются вновь выпущенные ценные бумаги

К вторичным ценным бумагам относятся:

- + ценные бумаги, для эмиссии которых должны существовать подкрепляющие их первичные ценные бумаги
- ценные бумаги, подкрепленные обращаемыми в госсекторе экономики активами
- ценные бумаги, предполагающие переуступку прав распоряжения ими

Критерии оценки портфеля ценных бумаг:

- рискованность, прибыльность, срок окупаемости
- ликвидность, срок окупаемости
- + надежность, рискованность, ликвидность, доходность

Ценовая функция рынка ценных бумаг заключается в:

- регламентации правил купли-продажи ценных бумаг по справедливым ценам
- + обеспечении рынком процесса установления рыночных цен и их постоянной динамики
- извлечении дохода от каждой операции с ценными бумагами

Структура рынка ценных бумаг представлена:

- капитальными вложениями государства и частных лиц
- + первичным и вторичным рынками
- обращаемым капиталом и ценными бумагами, в которые этот капитал вложен

Продажа банком ценных бумаг является:

- + операцией, осуществляемой на первичном рынке ценных бумаг
- операцией, осуществляемой на вторичном рынке ценных бумаг
- операцией, осуществляемой при непосредственном контроле государства

Операции с ценными бумагами:

- + эмиссионные, инвестиционные, посреднические
- эмиссионные, посреднические, ликвидационные
- эмиссионные, инвестиционные, посреднические, ликвидационные

К производным ценным бумагам относятся:

- + фьючерсные контракты, свободно обращающиеся опционы, свопы
- коносаменты, облигации, ипотечные закладные
- облигации, акции, векселя, трастовые сертификаты

Владение какой ценной бумагой дает возможность наращивать вложения за счет роста курсовой стоимости?

- облигацией государственного займа
- ипотечной ценной бумаги
- + акцией

Характерное свойство фьючерсного контракта – это:

- прописанные в нем условия обязательны для исполнения только продавцом ценной бумаги
- прописанные в нем условия обязательны для исполнения только покупателем ценной бумаги
- + прописанные в нем условия обязательны для исполнения как продавцом, так и покупателем ценной бумаги

Совокупность процедур по включению ценных бумаг в биржевой список – это:

- процессинг

- + листинг
- майнинг

Как изменится доходность ценной бумаги, если её рыночная цена уменьшится?

- +останется без изменений
- возрастет
- понижится

Цена, каких из перечисленных ценных бумаг определяется стоимостью основного средств?

- +опцион
- обыкновенная акция
- привилегированная акция

Можно ли снизить риск инвестиционного проекта путем страхования рисков?

- нет, так как такого вида страхования не существует
- страхование вообще нельзя рассматривать в качестве метода снижения риска инвестирования
- +да, с помощью страхования можно снизить риск инвестирования

По каким критериям принято классифицировать инвестиционные портфели?

- по степени риска и по количеству входящих в них ценных бумаг
- по степени риска и реакции на темпы инфляции
- +по степени риска и в зависимости от источника доходов по ценным бумагам портфеля

Какие из перечисленных ценных бумаг можно отнести к ценным бумагам с фиксированным доходом?

- государственная облигация
- бескупонная облигация
- +все перечисленные ценные бумаги

Инвестор сформировал «портфель дохода» из облигаций государственного сберегательного займа. За счет чего он намерен получать «доход»?

- дивидендов
- +купонного дохода
- курсовой разницы

Верно ли утверждение, что ценные бумаги с фиксированным доходом должны иметь заранее определенную схему выплаты дивидендов?

- +да, это является отличительной особенностью таких ценных бумаг
- нет, поскольку для дивидендов не вводится схема их выплат
- нет, так как по ценным бумагам этого вида дивиденды вообще не выплачиваются

Примерная тематика аналитической записки

Раздел дисциплины	Темы
Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	Оценить финансовые активы компании (на примере любого российского акционерного общества).
Методы оптимизации портфеля финансовых активов	Выработать стратегию управления финансовыми активами компании (на примере любого российского акционерного общества).

Практическая задача

Раздел дисциплины	Темы
Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	Сформировать портфель финансовых активов для компании. <u>Входные параметры:</u> - объем инвестиций не более 2 млн.руб.;

	<ul style="list-style-type: none"> - акции только российских эмитентов; - определить цель формирования портфеля; - определить посредника для формирования портфеля; - рассчитать доходность финансовых активов; - отразить горизонт инвестирования.
--	--

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Финансовые активы: виды, характеристики, управляемость	<ol style="list-style-type: none"> 1. Управление денежными средствами 2. Вложения в обыкновенные акции 3. Вложения в привилегированные акции 4. Вложения в облигации с купонным доходом 5. Вложения в бескупонные облигации 6. Хеджирование опционами 7. Оценка опционов 8. Инструменты коммерческого кредита 9. Влияние рисков на оценку стоимости долговых ценных бумаг 10. Влияние рисков на оценку долевых ценных бумаг 11. Хеджирование опционами 12. Фьючерсы: сущность, применение 13. Свопы: сущность, виды, применение
Методы оптимизации портфеля финансовых активов	<ol style="list-style-type: none"> 1. Модели оценки привилегированных акций. 2. Иммунизация портфеля финансовых активов. 3. Теория ожиданий. 4. Теория предпочтения ликвидности. 5. Рейтинг облигаций. 6. Инструменты коммерческого кредита. 7. Создание резервов под обесценение задолженности.

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	УК-6, ПК-3
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне