

Компонент ОПОП	38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Финансовый аналитик»
	наименование ОПОП
	ФТД.02
	шифр дисциплины

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Дисциплины (модуля)	Формирование оптимального инвестиционного портфеля
---------------------	--

Разработчик:
Царева С.В.
ФИО

Доцент кафедры ЭиУ
должность

К.Э.Н., доцент
ученая степень, звание

Утверждено на заседании кафедры
Экономики и управления
наименование кафедры

протокол № 6 от 19.02.2026 г.
заведующий кафедрой ЭиУ

 подпись
Щебарова Н.Н.
ФИО

1. Критерии и средства оценивания компетенций и индикаторов их достижения, формируемых дисциплиной (модулем)

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора(ов) достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)			Оценочные средства текущего контроля	Оценочные средства промежуточной аттестации
		<i>Знать</i>	<i>Уметь</i>	<i>Владеть</i>		
ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском	ИД-1_{ПК-4}: - понимает методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации; принципы расчета доходности активов; принципы портфельного управления инвестированием; принципы соотношения риска и доходности; способы управления финансовыми рисками ИД-2_{ПК-4}: - составляет инвестиционный портфель ИД-3_{ПК-4}: - рассчитывает величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; моделирует целевой портфель; рассчитывает параметры целевого инвестиционного портфеля; определяет критерии качества инвестиционного портфеля; анализирует изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля	понятие инвестиционного портфеля, его виды; методы управления портфелем реальных инвестиций; методы оценки эффективности вложений в инвестиционный портфель с учетом риска.	применять методы портфельного анализа для обеспечения требуемого уровня доходности; оценивать доходность портфеля реальных инвестиций	навыками составления оптимального портфеля реальных инвестиций	комплект заданий для выполнения практических работ	Результаты текущего контроля

2. Оценка уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)

Показатели оценивания компетенций (индикаторов их достижения)	Шкала и критерии ¹ оценки уровня сформированности компетенций (индикаторов их достижения)			
	Ниже порогового («неудовлетворительно»)	Пороговый («удовлетворительно»)	Продвинутый («хорошо»)	Высокий («отлично»)
Полнота знаний	Уровень знаний ниже минимальных требований. Имели место грубые ошибки.	Минимально допустимый уровень знаний. Допущены не грубые ошибки.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки. Допущены некоторые погрешности.	Уровень знаний в объёме, соответствующем программе подготовки.
Наличие умений	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы основные умения. Имели место грубые ошибки.	Продemonстрированы основные умения. Выполнены типовые задания с не грубыми ошибками. Выполнены все задания, но не в полном объеме (отсутствуют пояснения, неполные выводы)	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные задания с некоторыми погрешностями. Выполнены все задания в полном объёме, но некоторые с недочетами.	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Задания выполнены в полном объеме без недочетов.
Наличие навыков (владение опытом)	При выполнении стандартных заданий не продемонстрированы базовые навыки. Имели место грубые ошибки.	Имеется минимальный набор навыков для выполнения стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продemonстрированы базовые навыки при выполнении стандартных заданий с некоторыми недочетами.	Продemonстрированы все основные умения. Выполнены все основные и дополнительные задания без ошибок и погрешностей. Продemonстрирован творческий подход к решению нестандартных задач.
Характеристика сформированности компетенции	Компетенции фактически не сформированы. Имеющихся знаний, умений, навыков недостаточно для решения практических (профессиональных) задач. ИЛИ Зачетное количество баллов не набрано согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций соответствует минимальным требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в целом достаточно для решения практических (профессиональных) задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций в целом соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков достаточно для решения стандартных профессиональных задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону	Сформированность компетенций полностью соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в полной мере достаточно для решения сложных, в том числе нестандартных, профессиональных задач. ИЛИ Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону

¹ Критерии могут быть уточнены/изменены на усмотрение разработчика ФОС

3. Критерии и шкала оценивания заданий текущего контроля

3.1 Критерии и шкала оценивания практических работ

Перечень практических работ, описание порядка выполнения и защиты работы, требования к результатам работы, структуре и содержанию отчета и т.п. представлены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля) и в электронном курсе в ЭИОС МГТУ.

Оценка/баллы	Критерии оценивания
Отлично/60баллов	Выполнено 100 % практических работ. Отчет по практической работе подготовлен качественно в соответствии с требованиями. Полнота ответов на вопросы преподавателя при защите работы.
Хорошо/45баллов	Выполнено 75 % практических работ, нет достаточного обоснования или при верном решении допущена незначительная ошибка, не влияющая на правильную последовательность рассуждений. Все требования, предъявляемые к работе, выполнены.
Удовлетворительно/30 баллов	Выполнено 50 % практических работ. Демонстрирует средний уровень выполнения задания на практическую работу. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены.
Неудовлетворительно / 0 баллов	Выполнено менее 50 % практических работ со значительным количеством ошибок на низком уровне. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены. ИЛИ Практические работы не выполнены.

3.2 Критерии и шкала оценивания доклада /информационного сообщения

Тематика докладов, информационных сообщений по дисциплине (модулю), требования к структуре, содержанию и оформлению изложены в методических материалах по освоению дисциплины (модуля), представлены в электронном курсе в ЭИОС МАУ.

Оценка/баллы	Критерии оценки
Отлично/40 баллов	Ориентированность в материале, полные и аргументированные ответы на дополнительные вопросы. Материал изложен логически последовательно, присутствуют самостоятельные выводы, используется материал из дополнительных источников, интернет ресурсов. Сообщение носит исследовательский характер. Используется наглядный материал (презентация).
Хорошо/35 баллов	Ориентированность в материале, но присутствуют некоторые затруднения в ответах на дополнительные вопросы. Отсутствует исследовательский компонент в сообщении. Отсутствует наглядный материал (презентация).
Удовлетворительно/ 30 баллов	Трудности в подборе материала, его структурировании. Использована, в основном, учебная литература, не использованы дополнительные источники информации. Трудности в ответе на дополнительные вопросы по теме сообщения, формулировке выводов. Материал изложен не последовательно, не установлены логические связи.
Неудовлетворительно/0 баллов	Доклад, информационное сообщение подготовлено по одному источнику информации либо не соответствует теме. ИЛИ Доклад, информационное сообщение не подготовлено.

4. Критерии и шкала оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю) при проведении промежуточной аттестации

Критерии и шкала оценивания результатов освоения дисциплины (модуля) с зачетом

Если обучающийся набрал зачетное количество баллов согласно установленному диапазону по дисциплине (модулю), то он считается аттестованным.

Оценка	Баллы	Критерии оценивания
<i>Зачтено</i>	60 – 100	Набрано зачетное количество баллов согласно установленному диапазону
<i>Не зачтено</i>	менее 60	Зачетное количество согласно установленному диапазону баллов не набрано

5. Задания диагностической работы для оценки результатов обучения по дисциплине (модулю) в рамках внутренней и внешней независимой оценки качества образования

ФОС содержит задания для оценивания знаний, умений и навыков, демонстрирующих уровень сформированности компетенций и индикаторов их достижения в процессе освоения дисциплины (модуля).

Комплект заданий разработан таким образом, чтобы осуществить процедуру оценки каждой компетенции, формируемых дисциплиной (модулем), у обучающегося в письменной форме.

Содержание комплекта заданий включает: *тестовые задания*.

Комплект заданий диагностической работы

ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском	
1.	Выплаты дивидендов относятся к оттокам денежных средств от: 1) инвестиционной деятельности 2) операционной деятельности 3) финансовой деятельности
2.	По какому показателю формируется оптимальный портфель инвестиционных проектов на предприятии: 1) по показателю суммарной чистой текущей стоимости 2) по показателю суммарной внутренней норы доходности 3) по показателю суммарного индекса рентабельности
3.	Какой из показателей эффективности проекта не является относительным: 1) чистая текущая стоимость 2) индекс рентабельности 3) внутренняя норма доходности
4.	Какой метод оценки эффективности проекта не относится к группе сложных методов: 1) метод определения чистой текущей стоимости 2) метод определения индекса рентабельности 3) метод определения срока окупаемости
5.	Какое утверждение верно: 1) рубль, полученный сегодня стоит дешевле, чем рубль, полученный завтра

	2) рубль, полученный сегодня стоит дороже, чем рубль, полученный завтра 3) деньги не имеют временной стоимости
6.	К простым методам оценки эффективности не относится: 1) чистая текущая стоимость 2) норма прибыли на капитал 3) срок окупаемости
7.	Что из ниже перечисленного не является формой проектного финансирования: 1) финансирование с полным регрессом на заемщика 2) финансирование с ограниченным регрессом на заемщика 3) финансирование без регресса на заемщика 4) нет правильного ответа
8.	Для проверки финансовой реализуемости проекта достаточно, чтобы... было неотрицательным на каждом шаге расчета: 1) поток реальных денег 2) сальдо реальных денег 3) сальдо накопленных реальных денег
9.	Самофинансирование (самоинвестирование) осуществляется за счет...
10.	Какой вид финансовых операций применяется при оценке эффективности проектов...