

Документ подписан простой электронной подписью
 Информация о владельце:
 ФИО: Косенок Сергей Михайлович
 Должность: ректор
 Дата подписания: 16.06.2026 11:54:46
 Уникальный программный ключ:
 e3a68f3eaa1e62674b54f4998099d3d6bfdcf836

Тестовое задание для диагностического тестирования по дисциплине:

**«Управление инвестиционным портфелем»
 8 СЕМЕСТР**

Код, направление подготовки	38.03.01. «Экономика»
Направленность (профиль)	Финансы и кредит
Форма обучения	очная
Кафедра-разработчик	Экономики, учета и финансов
Выпускающая кафедра	Экономики, учета и финансов

Проверяемая компетенция	Задание	Варианты ответов	Тип сложности вопроса
ПК-1.2	Выберите один вариант ответа: Как называется совокупность ценных бумаг, принадлежащих инвестору?	а. фонд б. портфель в. биржа г. лот	низкий
ПК-1.2	Выберите один вариант ответа: Какой показатель отражает чувствительность доходности ценной бумаги к изменениям рынка?	а. альфа б. бета в. гамма г. дельта	низкий
ПК-1.2	Выберите один вариант ответа: Как называется процесс снижения риска за счёт включения в портфель различных активов?	а. хеджирование б. диверсификация в. иммунизация г. арбитраж	низкий
ПК-1.2	Выбор пропущенных слов: Внутренняя стоимость ценной бумаги — это её реальная стоимость, определяемая на основе _____ анализа		низкий
ПК-1.2	Выбор пропущенных слов: Кривые _____ показывают комбинации риска и доходности, которые дают инвестору одинаковую полезность		низкий
ПК-1.2	На соответствие: Установите соответствие между терминами:	1. Эффективная ставка 2. Внутренняя стоимость 3. Рыночная цена 4. Коэффициент Шарпа	средний

		<p>а. Учитывает все доходы и расходы операции</p> <p>б. Реальная стоимость на основе фундаментальных факторов</p> <p>в. Цена, по которой бумага торгуется на бирже</p> <p>г. Отношение избыточной доходности к риску</p>	
ПК-1.2	<p>Выбор пропущенных слов:</p> <p>Иммунизация портфеля облигаций позволяет защитить его от _____ риска</p>		средний
ПК-1.2	<p>Выбор пропущенных слов:</p> <p>Коэффициент _____ показывает, _____ насколько доходность ценной бумаги зависит от колебаний рынка</p>		средний
ПК-1.2	<p>На соответствие:</p> <p>Установите соответствие между терминами</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. CAPM 2. Модель Гордона 3. Модель Марковица 4. Модель Блэка-Литтермана <p>а. Оценка стоимости акций по дисконтированным дивидендам</p> <p>б. Оценка ожидаемой доходности с учётом рыночного риска</p> <p>в. Минимизация риска портфеля при заданной доходности</p> <p>г. Сочетание рыночных и субъективных взглядов при формировании портфеля</p>	средний
ПК-1.2	<p>Выбор пропущенных слов:</p> <p>В модели Марковица задача состоит в минимизации _____ при заданной доходности</p>		средний
ПК-1.2	<p>Выберите один вариант ответа:</p> <p>Какая модель используется для оценки стоимости акций на основе _____ дисконтированных</p>	<ol style="list-style-type: none"> а. Модель Блэка-Шоулза б. Модель Гордона в. Модель Марковица г. Модель CAPM 	средний

	дивидендов?		
ПК-1.2	Выберите один вариант ответа: Какой подход к управлению портфелем предполагает следование рыночному индексу?	а. Активный б. Пассивный в. Агрессивный г. Консервативный	средний
ПК-1.2	Выберите один вариант ответа: Как называется ставка, учитывающая все доходы и расходы по финансовой операции?	а. Номинальная б. Эффективная в. Рыночная г. Безрисковая	средний
ПК-1.2	Выберите один правильный ответ: Какой инструмент используется для страхования портфеля от убытков?	а. Акция б. Облигация в. Производные финансовые инструменты г. Депозиты	средний
ПК-1.2	На соответствие: Установите соответствие между терминами.	1. Альфа 2. Бета 3. Дюрация 4. Хеджирование а. Мера чувствительности к рынку б. Избыточная доходность над ожидаемой в. Средневзвешенный срок платежей по облигации г. Страхование от убытков	средний
ПК-1.2	Все или ничего: Выберите все верные утверждения о диверсификации	а. Снижает общий риск портфеля б. Не влияет на ожидаемую доходность в. Требуется включения активов с низкой корреляцией г. Применима только для акций	высокий
ПК-1.2	Все или ничего Выберите все компоненты, входящие в расчёт коэффициента Шарпа	а. Доходность портфеля б. Безрисковая ставка в. Стандартное отклонение доходности портфеля г. Бета-коэффициент портфеля	высокий
ПК-1.2	Все или ничего: Выберите все верные утверждения о модели CAPM	а. Связывает ожидаемую доходность с рыночным риском (бета) б. Предполагает эффективность рынка в. Не учитывает индивидуальные риски активов г. Применима только для облигаций	высокий
ПК-1.2	Все или ничего: Выберите все этапы процесса формирования портфеля	а. Анализ рынка и активов б. Определение инвестиционных целей и	высокий

		ограничений в. Формирование портфеля (выбор бумаг) г. Продажа всех активов в конце года	
ПК-1.2	Все или ничего: Выберите все верные утверждения о дюрации облигации	а. Показывает средневзвешенный срок получения платежей б. Используется для оценки процентного риска в. Равна сроку до погашения для бескупонных облигаций г. Всегда больше срока до погашения для купонных облигаций	высокий