



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ГЕОДЕЗИИ И КАРТОГРАФИИ
(МИИГАиК)

Факультет управления территориями
Кафедра управления недвижимостью и развитием территорий



**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

Сертификат: 5387FD2AF5B17FED816FDE9A1D4973B1
Владелец: Степанченко Алексей Леонидович
Действителен: с 21.07.2025 по 14.10.2026

«УТВЕРЖДАЮ»

Проректор
А. Л. Степанченко
18 апреля 2025 г.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)
ОРГАНИЗАЦИОННО-ЭКОНОМИЧЕСКИЕ И ПРАВОВЫЕ ОСНОВЫ
БИЗНЕС-АНАЛИЗА В СФЕРЕ НЕДВИЖИМОСТИ
«Б1.В.01.07.05 УПРАВЛЕНИЕ ПОРТФЕЛЕМ НЕДВИЖИМОСТИ»**

Уровень высшего образования: бакалавриат

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность(профиль) подготовки: Бизнес-аналитика в сфере недвижимости

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Форма обучения: очная

Год набора (приема на обучение): 2025

Срок получения образования: 4 года

Объем:
в зачетных единицах: 4 з.е.
в академических часах: 144 ак.ч.

Москва, 2025

Разработчики:

Доцент кафедры Управления недвижимостью и развитием территорий, к.н. Кривичев А. И.

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) составлен в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденного приказом Минобрнауки от 12.08.2020 № 957

Согласование и утверждение

№	Подразделение	Ответственное лицо	ФИО	Виза	Дата, протокол (при наличии)
1	факультет Управления территориями	Председатель ученого совета факультета	Воронцова А. А.	Рассмотрено	19.12.2024, № 2-2024

1. Планируемые результаты обучения, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений

УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения

Знать:

УК-2.2/Зн1 Методологии проектного управления: Знать основные методологии проектного управления, которые помогают в установлении связей между задачами и ожидаемыми результатами.

УК-2.2/Зн2 Критерии успеха проекта: Знать критерии и показатели, по которым будет оцениваться успешность решения задач и достижения результатов, такие как КРІ (ключевые показатели эффективности).

УК-2.2/Зн3 Анализ взаимозависимостей: Понимать методы анализа взаимозависимостей между задачами, включая диаграммы Ганта, сетевые графики и другие инструменты планирования.

Уметь:

УК-2.2/Ум1 Уметь выстраивать логическую цепочку между поставленными задачами и ожидаемыми результатами, определяя, как выполнение одной задачи влияет на другие. Формулировать цели и задачи:

УК-2.2/Ум2 Уметь формулировать конкретные цели и задачи, исходя из ожидаемых результатов, и связывать их с общими целями проекта. Оценивать влияние задач на результаты:

УК-2.2/Ум3 Уметь оценивать, как выполнение или невыполнение задач может повлиять на достижения ожидаемых результатов, включая анализ рисков и возможностей.

Владеть:

УК-2.2/Нв1 Навыками системного мышления: Владеть навыками системного мышления, позволяющими видеть связи между различными задачами и их влиянием на общий результат проекта.

УК-2.2/Нв2 Инструментами визуализации: Владеть инструментами визуализации (например, ментальные карты, диаграммы связей), которые помогают наглядно представить взаимосвязи между задачами и результатами.

УК-2.2/Нв3 Коммуникационными навыками: Владеть коммуникационными навыками для эффективного обсуждения и объяснения связей между задачами и результатами с командой и заинтересованными сторонами.

ПК-1 Способен формировать решения с учетом знаний предметной области и отраслевой специфики бизнес-анализа

ПК-1.2 Использует методические подходы к подбору исходных данных для осуществления расчетов

Знать:

ПК-1.2/Зн1 Методические подходы к анализу данных: Знать различные методические подходы к подбору и обработке исходных данных, включая количественные и качественные методы, а также их применение в бизнес-анализе.

ПК-1.2/Зн2 Критерии выбора данных: Знать критерии, по которым осуществляется выбор исходных данных для расчетов, такие как актуальность, надежность, полнота и репрезентативность..

ПК-1.2/Зн3 Стандарты и нормативы в сфере недвижимости: Знать существующие стандарты и нормативы, регулирующие сбор и обработку данных в сфере недвижимости, которые могут влиять на выбор исходных данных

Уметь:

ПК-1.2/Ум1 Подбирать исходные данные: Уметь эффективно подбирать исходные данные для расчетов, основываясь на методических подходах и критериях выбора, чтобы обеспечить достоверность и точность анализа.

ПК-1.2/Ум2 Оценивать качество данных: Уметь оценивать качество собранных данных, выявлять возможные источники ошибок и корректировать их при необходимости.

ПК-1.2/Ум3 Применять методические подходы на практике: Уметь применять выбранные методические подходы к подбору и обработке данных в реальных проектах и задачах бизнес-анализа.

Владеть:

ПК-1.2/Нв1 Навыками работы с аналитическими инструментами: Владеть навыками работы с аналитическими инструментами и программным обеспечением для обработки и анализа данных, такими как Excel, SPSS, R или Python.

ПК-1.2/Нв2 Методами верификации данных: Владеть методами верификации и проверки данных, чтобы удостовериться в их корректности перед проведением расчетов.

ПК-1.2/Нв3 Способами документирования процессов: Владеть способами документирования процессов подбора и обработки данных, что позволит обеспечить прозрачность и воспроизводимость аналитических решений.

2. Показатели и критерии оценивания компетенций

Планируемые результаты освоения программы	Уровень овладения	Критерии оценивания (перечень сформированных ИДК/ЗУВ по уровням освоения)
---	-------------------	---

УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Повышенный	ИДК УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения Знать: УК-2.2/Зн1 Методологии проектного управления: Знать основные методологии проектного управления, которые помогают в установлении связей между задачами и ожидаемыми результатами. УК-2.2/Зн2 Критерии успеха проекта: Знать критерии и показатели, по которым будет оцениваться успешность решения задач и достижения результатов, такие как КРІ (ключевые показатели эффективности). УК-2.2/Зн3 Анализ взаимозависимостей: Понимать методы анализа взаимозависимостей между задачами, включая диаграммы Ганта, сетевые графики и другие инструменты планирования. Уметь: УК-2.2/Ум1 Уметь выстраивать логическую цепочку между поставленными задачами и ожидаемыми результатами, определяя, как выполнение одной задачи влияет на другие. Формулировать цели и задачи: УК-2.2/Ум2 Уметь формулировать конкретные цели и задачи, исходя из ожидаемых результатов, и связывать их с общими целями проекта. Оценивать влияние задач на результаты: УК-2.2/Ум3 Уметь оценивать, как выполнение или невыполнение задач может повлиять на достижения ожидаемых результатов, включая анализ рисков и возможностей. Владеть: УК-2.2/Нв1 Навыками системного мышления: Владеть навыками системного мышления, позволяющими видеть связи между различными задачами и их влиянием на общий результат проекта. УК-2.2/Нв2 Инструментами визуализации: Владеть инструментами визуализации (например, ментальные карты, диаграммы связей), которые помогают наглядно представить взаимосвязи между задачами и результатами. УК-2.2/Нв3 Коммуникационными навыками: Владеть коммуникационными навыками для эффективного обсуждения и объяснения связей между задачами и результатами с командой и заинтересованными сторонами.
--	-------------------	---

Базовый	ИДК УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения Знать: УК-2.2/Зн1 Методологии проектного управления: Знать основные методологии проектного управления, которые помогают в установлении связей между задачами и ожидаемыми результатами. УК-2.2/Зн2 Критерии успеха проекта: Знать критерии и показатели, по которым будет оцениваться успешность решения задач и достижения результатов, такие как КРІ (ключевые показатели эффективности). УК-2.2/Зн3 Анализ взаимозависимостей: Понимать методы анализа взаимозависимостей между задачами, включая диаграммы Ганта, сетевые графики и другие инструменты планирования. Уметь: УК-2.2/Ум1 Уметь выстраивать логическую цепочку между поставленными задачами и ожидаемыми результатами, определяя, как выполнение одной задачи влияет на другие. Формулировать цели и задачи: УК-2.2/Ум2 Уметь формулировать конкретные цели и задачи, исходя из ожидаемых результатов, и связывать их с общими целями проекта. Оценивать влияние задач на результаты: УК-2.2/Ум3 Уметь оценивать, как выполнение или невыполнение задач может повлиять на достижения ожидаемых результатов, включая анализ рисков и возможностей.
Пороговый	ИДК УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения Знать: УК-2.2/Зн1 Методологии проектного управления: Знать основные методологии проектного управления, которые помогают в установлении связей между задачами и ожидаемыми результатами. УК-2.2/Зн2 Критерии успеха проекта: Знать критерии и показатели, по которым будет оцениваться успешность решения задач и достижения результатов, такие как КРІ (ключевые показатели эффективности). УК-2.2/Зн3 Анализ взаимозависимостей: Понимать методы анализа взаимозависимостей между задачами, включая диаграммы Ганта, сетевые графики и другие инструменты планирования.

ПК-1 Способен формировать решения с учетом знаний предметной области и отраслевой специфики бизнес-анализа	Повышенный	ИДК ПК-1.2 Использует методические подходы к подбору исходных данных для осуществления расчетов Знать: ПК-1.2/Зн1 Методические подходы к анализу данных: Знать различные методические подходы к подбору и обработке исходных данных, включая количественные и качественные методы, а также их применение в бизнес-анализе. ПК-1.2/Зн2 Критерии выбора данных: Знать критерии, по которым осуществляется выбор исходных данных для расчетов, такие как актуальность, надежность, полнота и репрезентативность.. ПК-1.2/Зн3 Стандарты и нормативы в сфере недвижимости: Знать существующие стандарты и нормативы, регулирующие сбор и обработку данных в сфере недвижимости, которые могут влиять на выбор исходных данных Уметь: ПК-1.2/Ум1 Подбирать исходные данные: Уметь эффективно подбирать исходные данные для расчетов, основываясь на методических подходах и критериях выбора, чтобы обеспечить достоверность и точность анализа. ПК-1.2/Ум2 Оценивать качество данных: Уметь оценивать качество собранных данных, выявлять возможные источники ошибок и корректировать их при необходимости. ПК-1.2/Ум3 Применять методические подходы на практике: Уметь применять выбранные методические подходы к подбору и обработке данных в реальных проектах и задачах бизнес-анализа. Владеть: ПК-1.2/Нв1 Навыками работы с аналитическими инструментами: Владеть навыками работы с аналитическими инструментами и программным обеспечением для обработки и анализа данных, такими как Excel, SPSS, R или Python. ПК-1.2/Нв2 Методами верификации данных: Владеть методами верификации и проверки данных, чтобы удостовериться в их корректности перед проведением расчетов. ПК-1.2/Нв3 Способами документирования процессов: Владеть способами документирования процессов подбора и обработки данных, что позволит обеспечить прозрачность и воспроизводимость аналитических решений.
---	-------------------	---

Базовый	ИДК ПК-1.2 Использует методические подходы к подбору исходных данных для осуществления расчетов Знать: ПК-1.2/Зн1 Методические подходы к анализу данных: Знать различные методические подходы к подбору и обработке исходных данных, включая количественные и качественные методы, а также их применение в бизнес-анализе. ПК-1.2/Зн2 Критерии выбора данных: Знать критерии, по которым осуществляется выбор исходных данных для расчетов, такие как актуальность, надежность, полнота и репрезентативность.. ПК-1.2/Зн3 Стандарты и нормативы в сфере недвижимости: Знать существующие стандарты и нормативы, регулирующие сбор и обработку данных в сфере недвижимости, которые могут влиять на выбор исходных данных Уметь: ПК-1.2/Ум1 Подбирать исходные данные: Уметь эффективно подбирать исходные данные для расчетов, основываясь на методических подходах и критериях выбора, чтобы обеспечить достоверность и точность анализа. ПК-1.2/Ум2 Оценивать качество данных: Уметь оценивать качество собранных данных, выявлять возможные источники ошибок и корректировать их при необходимости. ПК-1.2/Ум3 Применять методические подходы на практике: Уметь применять выбранные методические подходы к подбору и обработке данных в реальных проектах и задачах бизнес-анализа.
Пороговый	ИДК ПК-1.2 Использует методические подходы к подбору исходных данных для осуществления расчетов Знать: ПК-1.2/Зн1 Методические подходы к анализу данных: Знать различные методические подходы к подбору и обработке исходных данных, включая количественные и качественные методы, а также их применение в бизнес-анализе. ПК-1.2/Зн2 Критерии выбора данных: Знать критерии, по которым осуществляется выбор исходных данных для расчетов, такие как актуальность, надежность, полнота и репрезентативность.. ПК-1.2/Зн3 Стандарты и нормативы в сфере недвижимости: Знать существующие стандарты и нормативы, регулирующие сбор и обработку данных в сфере недвижимости, которые могут влиять на выбор исходных данных

3. Шкала оценивания

Оценка	Критерии оценивания (перечень сформированных ИДК/ЗУВ)
Зачтено	УК-2.2 Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения УК-2.2/Зн3 Анализ взаимозависимостей: Понимать методы анализа взаимозависимостей между задачами, включая диаграммы Ганта, сетевые графики и другие инструменты планирования. УК-2.2/Зн2 Критерии успеха проекта: Знать критерии и показатели, по которым будет оцениваться успешность решения задач и достижения результатов, такие как КРІ (ключевые показатели эффективности). УК-2.2/Зн1 Методологии проектного управления: Знать основные методологии проектного управления, которые помогают в установлении связей между задачами и ожидаемыми результатами. ПК-1.2 Использует методические подходы к подбору исходных данных для осуществления расчетов ПК-1.2/Зн2 Критерии выбора данных: Знать критерии, по которым осуществляется выбор исходных данных для расчетов, такие как актуальность, надежность, полнота и репрезентативность.. ПК-1.2/Зн1 Методические подходы к анализу данных: Знать различные методические подходы к подбору и обработке исходных данных, включая количественные и качественные методы, а также их применение в бизнес-анализе. ПК-1.2/Зн3 Стандарты и нормативы в сфере недвижимости: Знать существующие стандарты и нормативы, регулирующие сбор и обработку данных в сфере недвижимости, которые могут влиять на выбор исходных данных
Не зачтено	Результаты обучения не сформированы на достаточном уровне

4. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля/Оценочное средство
Текущий контроль	Тестирование Решение задач
Промежуточная аттестация	Расчетно-графическая работа Зачет

№ п/п	Наименование раздела	Контролируемые ИДК	Вид контроля/ используемые оценочные материалы	
			Текущий	Промежут. аттестация
1	Исторический аспект развития инвестирования в недвижимость	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование Решение задач	Зачет
2	Свойства недвижимости как объекта инвестиций	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
3	Доходы и риски при инвестировании в недвижимость	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
4	Показатели единичного актива портфеля недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет

5	Инструменты инвестирования в недвижимость	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
6	Современная концепция управления портфелем недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
7	Интерпретация классических портфельных моделей для портфеля недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
8	Стратегии управления портфелем недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
9	. Система управления портфелем недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
10	Многофакторная модель - Арбитражная модель Росса	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет
11	Оценка эффективности управления портфелем недвижимости	УК-2.2 ПК-1.2	Тестирование	Зачет

5. Порядок проведения промежуточной аттестации

Порядок проведения промежуточной аттестации регламентируется локальными нормативными актами Университета:

- Положением о формах, периодичности, порядке текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Московский государственный университет геодезии и картографии», п.6 «Организация и проведение промежуточной аттестации».
- Положением о порядке осуществления образовательного процесса, проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с применением электронного обучения и дистанционных образовательных технологий в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Московский государственный университет геодезии и картографии», п.8 «Проведение промежуточной аттестации с применением ЭО и ДОТ».

Промежуточная аттестация: Зачет, 7 семестр.

К промежуточной аттестации допускаются студенты, полностью выполнившие все обязательные работы в рамках текущего контроля по дисциплине. Промежуточная аттестация проводится по билетам. На подготовку к ответу отводится 20-40 минут. Сначала студент пишет ответ на вопросы билета, затем устно отвечает на наводящие вопросы, связанные с вопросами билета.

6. Оценочные материалы текущего контроля

Раздел 1. Исторический аспект развития инвестирования в недвижимость

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 1.1. Исторический аспект развития инвестирования в недвижимость

Форма контроля/оценочное средство: Решение задач

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. В какое время в США недвижимость стала всерьез восприниматься как чистый актив?

1. В 1960-е годы XX века
2. В 1970-е годы XX века
3. В 1980-е годы XX века
4. В 1990-е годы XX века

Раздел 2. Свойства недвижимости как объекта инвестиций

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 2.1. Оценка эффективности инвестиций в недвижимость.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Отметьте особенности недвижимости как товара:
 - 1) низкая ликвидность недвижимости
 - 2) высокий уровень издержек на проведение сделок
 - 3) сезонные колебания цены
 - 4) дефицитность
 - 5) низкая взаимозаменяемость объектов

Раздел 3. Доходы и риски при инвестировании в недвижимость

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 3.1. Доходы и риски при инвестировании в недвижимость

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Что входит в три основных компонента доходов от недвижимости?
 1. Доходы от аренды, доходы от продажи и налоговые льготы
 2. Денежный поток, влияние налогов, изменения в стоимости капитала
 3. Инфляция, прибыль от аренды, страхование
 4. Первичный доход, вторичный доход, амортизация

Раздел 4. Показатели единичного актива портфеля недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 4.1. Показатели не имеющие дисконтированной основы. Показатели на дисконтированной основе. Примеры расчета показателей единичного актива .

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Что означает термин чистая приведенная стоимость (NPV)?
 - 1) Разница между стоимостью покупки и продажи недвижимости
 - 2) Сумма дисконтированных чистых денежных потоков за вычетом первоначальных инвестиций
 - 3) Коэффициент рентабельности капитала
 - 4) Процент роста рыночной стоимости недвижимости

Раздел 5. Инструменты инвестирования в недвижимость

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 5.1. Инструменты инвестирования в недвижимость с минимальным риском. Инструменты инвестирования в недвижимость с относительным риском. Инструменты инвестирования в недвижимость с максимальным риском.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Какой финансовый инструмент дает право купить недвижимость по заранее установленной цене?

- 1) Ипотечный кредит
- 2) Опцион
- 3) Финансовый лизинг
- 4) Валовой мультипликатор

Раздел 6. Современная концепция управления портфелем недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 6.1. Классификация недвижимости как актива. . Формирование и оптимизация портфеля недвижимости. Оценка доходности и риска портфеля недвижимости.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Понятия “движимые” и “недвижимые” вещи трансформировались в категории “основные” и “оборотные” фонды в Советский период после отмены частной собственности на землю. Верно или нет?

- 1) верно
- 2) неверно

Раздел 7. Интерпретация классических портфельных моделей для портфеля недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 7.1. Модель Марковица для портфеля недвижимости. Модели Шарпа-Трейнора для портфеля недвижимости. Примеры интерпретации классических портфельных моделей для портфеля недвижимости .

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Какой показатель используется в модели Шарпа для оценки риска?

- 1) Дисконтированная стоимость
- 2) Коэффициент β (бета)
- 3) Чистая приведенная стоимость (NPV)
- 4) Коэффициент ликвидности

Раздел 8. Стратегии управления портфелем недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 8.1. Пассивная стратегия для портфеля недвижимости . Активной стратегия для портфеля недвижимости . Определение удельных весов, доходности, риска и альфы в рыночном портфеле.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Какая стратегия сводится к частому пересмотру портфеля?

- 1) Активная стратегия
- 2) Пассивная стратегия

Раздел 9. . Система управления портфелем недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 9.1. Современная система управления портфелем недвижимости, . Управление эффективностью, риском, полезностью, справедливой стоимостью в системе управления портфелем недвижимости. Примеры сравнение линии рынка капитала CML и линии рынка актива SML..

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. В чем заключается основная цель стратегического управления портфелем недвижимости?

- 1) Максимизация текущего дохода от аренды
- 2) Контроль параметров портфеля и его адаптация к изменяющимся условиям
- 3) Оптимизация налогообложения
- 4) Минимизация инвестиционных рисков

Раздел 10. Многофакторная модель - Арбитражная модель Росса

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 10.1. Арбитражная модель Росса для одного фактора риска. Формирование арбитражного портфеля при наличии двух и более факторов риска. Пример определения ожидаемой доходности актива для двух факторов риска.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Чему равна сумма всех удельных весов активов в арбитражном портфеле?

- 1) 1 (один)
- 2) 0 (ноль)
- 3) - 1 (минус один)

Раздел 11. Оценка эффективности управления портфелем недвижимости

Контролируемые ИДК: ПК-1.2 УК-2.2

Тема 11.1. Оценка доходности портфеля недвижимости при помощи коэффициент эффективности Шарпа . Оенка доходности портфеля недвижимости при помощи коэффициента эффективности Трейнора. Определение коэффициентов эффективности Шарпа и Трейнора.

Форма контроля/оценочное средство: Тестирование

Вопросы/Задания:

1. Дать оценку эффективности двум портфелям (1-ый и 2-ой) на рисунке:

- 1) Оба портфеля одинаково эффективны
- 2) Оба портфеля не эффективны
- 3) Первый портфель более эффективен чем второй
- 4) Второй портфель более эффективен чем первый

7. Оценочные материалы промежуточной аттестации

7 семестр, Зачет

Контролируемые ИДК: УК-2.2 ПК-1.2

Вопросы/Задания:

1. В каком году впервые в России появился термин “недвижимость”?

2. Является ли характерной чертой инвестиций в недвижимость то, что они рассчитаны на получение будущих доходов?

3. Выбрать из списка риски при инвестировании в собственный капитал:

- 1) риск типа недвижимости безотносительно местоположения определяются предложением и спросом
- 2) риск местоположения (местное предложение и спрос)
- 3) арендный и кредитный риски (вероятность неуплаты арендатором аренды, долга по аренде)
- 4) риск законодательного регулирования и изменения налогообложения
- 5) инфляционный риск
- 6) риск реинвестирования