

УТВЕРЖДЕНО:
Зав. кафедрой «Экономика, финансы и менеджмент»
М.В. Корниенко
Протокол № 6 от «27» 01 2022 года

**Примерный перечень вопросов к экзамену по дисциплине
«Управление программами и портфелями проектов»
для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.02
Менеджмент профиль «Корпоративное управление»**

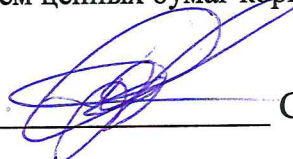
2021/2022 учебный год

1. Основные допущения модели Марковица.
2. Корреляция ценных бумаг и риск портфеля.
3. Кривые безразличия.
4. Эффективное множество портфелей.
5. Понятие оптимального портфеля и способы его построения.
6. Использование модели Марковица при выборе инвестиционного портфеля, ее недостатки.
7. Модели оценки долгосрочных активов Шарпа.
8. Инвестиции в безрисковые активы.
9. Подход Тобина.
10. Модель ценообразования на капитальные активы (Capital Asset Pricing Model, CAPM).
11. Линия рынка капитала и линия рынка ценных бумаг (Capital market line, CML; Security market line, SML): уравнения, экономическая интерпретация.
12. Бета (β -коэффициент) корпорации. Факторы, влияющие на β -коэффициент.
13. Недооцененные и переоцененные ценные бумаги.
14. Арбитражная теория ценообразования (Arbitrage Pricing Theory, АРТ) на финансовые активы.
15. Однофакторная и многофакторные арбитражные модели.
16. Опцион: понятие, особенности, ценность. Виды опционов.
17. Оценка опционов. Факторы, воздействующие на стоимость опциона.
18. Модели оценки опционов.
19. Модель оценки опционов Блэка – Шоулза.
20. Область применения теории опционов и модели ценообразования опционов.
21. Влияние риска и неопределенности при оценке эффективности проекта.
22. Управление стоимостью проекта.

23. Контроль и регулирование проекта.
24. Использование пакетов прикладных программ в управлении проектами.
25. Водопадная (каскадная, последовательная) модель.
26. Спиральная модель.
27. Стратегический менеджмент: состав и содержание функций управления проектом.
28. Метод критического пути.
29. Метод PERT.
30. Команда менеджеров проекта.
31. Программные средства управления проектами.
32. Содержание работ по созданию проекта.
33. Информационные системы управления проектами.
34. Типовая информационно-логическая модель системы управления проектами.
35. Ресурсы проекта и их типы.
36. SMART- критерии в проекте.
37. Основы инструментария проектного менеджмента.
38. Проектный цикл. Структуризация проектов.
39. Окружающая среда проекта.
40. Портфель ценных бумаг: цели, задачи, принципы формирования.
41. Классификация портфелей ценных бумаг.
42. Этапы инвестиционного процесса.
43. Ожидаемая доходность и риск инвестиционного портфеля.
44. Диверсифицируемые и недиверсифицируемые риски.
45. Основные способы диверсификации портфеля
46. Модель Марковица.
47. Понятие оптимального портфеля и способы его построения.
48. Модели оценки долгосрочных активов Шарпа.
49. Инвестиции в безрисковые активы.
50. Линия рынка капитала и линия рынка ценных бумаг.
51. Стили управления портфелем инвестиций.
52. Пассивное и активное управление инвестиционным портфелем.
53. Оценка эффективности управления портфелем ценных бумаг.
54. Издержки управления портфелем.
55. Тенденции портфельных инвестиций на рынке ценных бумаг в 2012-2022 гг.
56. Возможности применения основных положений современной портфельной теории при формировании и управлении портфелем ценных бумаг корпорации в РФ.

К.э.н., доцент кафедры

«Экономика, финансы и менеджмент»



С.А. Баженова