Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 09.11.2026 13:56:17
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И
ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

Кафедра финансов и экономической безопасности

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
_____ Л. А. Омельянович
«21» _____02_____ 2024 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по учебной дисциплине

Б1.В.ДВ.03.02 Инвестиционный анализ

38.03.01Экономика
(код и наименование направления подготовки)

Финансы и кредит
(наименование профиля)

Разработчик:
доцент _____ Нефёдова Ю.В.
(должность) (подпись)

Оценочные материалы рассмотрены и утверждены на заседании кафедры от«_21_»_____02_____2024г., протокол№_21_

Донецк – 2024 г.

Паспорт

оценочных материалов по учебной дисциплине

_____Инвестиционный анализ_____

(наименование учебной дисциплины)

Перечень компетенций, формируемых в результате освоения учебной дисциплины (модуля)

№ п/п	Код и наименование контролируемой компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Этапы формирования (семестр изучения)
1	ПК-2 Способен проводить анализ, обоснование и выбор решения.	**Тема 1.** Сущность, цель и задачи инвестиционного анализа.	6
		Тема 2. Инвестиции в системе рыночных отношений.	6
		Тема 3. Сущность, принципы и требования реализации инвестиционных проектов.	6
		Тема 4. Анализ инвестиционного проекта в условиях риска.	6
		Тема 5. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов.	6
		Тема 6. Анализ и оценка денежных потоков инвестиционного проекта.	6
		Тема 7. Дисконтирование и оценка стоимости капитала.	6
		Тема 8. Оценка инвестиционного проекта в условиях риска и неопределенности.	6

Показатели и критерии оценивания компетенций, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций

Код контролируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Наименование оценочного средства
ПК-2 Способен проводить анализ, обоснование и выбор решения.	ИД-1ПК-2 Проводит анализ решений с точки зрения достижения целевых показателей решений. ИД-2ПК-2 Осуществляет оценку ресурсов, необходимых для реализации решений. ИД-3ПК-2 Проводит оценку эффективности каждого варианта решения как соотношения между ожидаемым уровнем использования ресурсов и ожидаемой ценностью.	Тема 1. Сущность, цель и задачи инвестиционного анализа.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 2. Инвестиции в системе рыночных отношений.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 3. Сущность, принципы и требования реализации инвестиционных проектов.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 4. Анализ инвестиционного проекта в условиях риска.	собеседование, разноуровневые задачи и задания (ТМК 2)
		Тема 5. Методы оценки эффективности инвестиционных проектов.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 6. Анализ и оценка денежных потоков инвестиционного проекта	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 7. Дисконтирование и оценка стоимости капитала.	собеседование, разноуровневые задачи и задания
		Тема 8. Оценка инвестиционного проекта в условиях риска и неопределенности.	собеседование, разноуровневые задачи и задания (ТМК 2)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Собеседование»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
6-8	Ответы на поставленные вопросы излагаются логично, последовательно и не требуют дополнительных пояснений. Полно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Делаются обоснованные выводы. Демонстрируются глубокие знания базовых нормативно-правовых актов. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов > 90%)
4-6	Ответы на поставленные вопросы излагаются систематизировано и последовательно. Базовые нормативно-правовые акты используются, но в недостаточном объеме. Материал излагается уверенно. Раскрыты причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируется умение анализировать материал, однако не все выводы носят аргументированный и доказательный характер. Соблюдаются нормы литературной речи (количество правильных ответов >70%)
2-4	Допускаются нарушения в последовательности изложения. Имеются упоминания об отдельных базовых нормативно-правовых актах. Неполно раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Демонстрируются поверхностные знания вопроса, с трудом решаются конкретные задачи. Имеются затруднения с выводами. Допускаются нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов >50%)
0-2	Материал излагается непоследовательно, сбивчиво, не представляет определенной системы знаний по дисциплине. Не раскрываются причинно-следственные связи между явлениями и событиями. Не проводится анализ. Выводы отсутствуют. Ответы на дополнительные вопросы отсутствуют. Имеются заметные нарушения норм литературной речи (количество правильных ответов <50%)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Разноуровневые задачи и задания»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
6-8	Задачи и задания выполнены на высоком уровне (даны правильные ответы на 75-100% вопросов/задач)
4-6	Задачи и задания выполнены на среднем уровне (даны правильные ответы на 50-74% вопросов/задач)
2-4	Задачи и задания выполнены на низком уровне (даны правильные ответы на 25-49% вопросов/задач)
0-2	Задачи и задания выполнены на неудовлетворительном уровне (даны правильные ответы на 0-24% вопросов/задач)

Критерии и шкала оценивания по оценочному материалу «Контрольная работа»

Шкала оценивания (интервал баллов)	Критерии оценивания
6-8	Контрольная работа выполнена на высоком уровне (правильные ответы даны на 90-100% вопросов/задач)
4-6	Контрольная работа выполнена на среднем уровне (правильные ответы даны на 75-89% вопросов/задач)
2-4	Контрольная работа выполнена на низком уровне (правильные ответы даны на 60-74% вопросов/задач)
0-2	Контрольная работа выполнена на неудовлетворительном уровне (правильные ответы даны менее чем 60%)

Перечень оценочных материалов

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	Собеседование	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой учебной дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по учебной дисциплине или определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы по темам/разделам учебной дисциплины
2.	Разноуровневые задачи и задания	Различают задачи и задания: а) репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела учебной дисциплины; б) реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения интезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; в) творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения	Комплект разноуровневых задач и заданий
3.	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме, разделу или учебной дисциплине	Комплект контрольных заданий по вариантам

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

Смысловой модуль 1. Теоретические основы инвестиционного анализа.

1. Инвестиционный анализ: история развития, сущность и основные задачи.
2. Цели, задачи и содержание инвестиционного анализа.
3. Функции инвестиционного анализа.
4. Принципы инвестиционного анализа.
5. Международные и российские стандарты инвестиционного анализа и оценки инвестиционных проектов.
6. Классификация информационных данных в инвестиционном анализе.
7. Схема взаимодействия отдельных блоков инвестиционного анализа.
8. Учет особенностей инвестиционных решений.
9. Факторы, осложняющие принятие инвестиционного решения.
10. Информационная база инвестиционного решения и ее составные массивы.
11. Сущность инвестиционного планирования и его использование в практике.
12. Инвестиционный контроль: оценка целесообразности его использования менеджерами.
13. Инвестиционная активность предприятия и её влияние на состояние экономики.
14. Экономическая сущность инвестиций, инвестиционного процесса и инвестиционной политики.
15. Экономическое содержание инвестиций.
16. Причины осуществления инвестиционных решений.
17. Роль инвестиций на макро- и микроуровне.
18. Классификация видов инвестиций.
19. Субъекты и объекты инвестиционной деятельности.
20. Формы реальных инвестиций.
21. Источники капитальных вложений.
22. Государственное регулирование капитальных вложений.
23. Инвестиционный процесс и его участники.
24. Инвестиционная политика на микроуровне.
25. Процесс разработки и формирования инвестиционной политики.
26. Сущность и виды инвестиционных проектов.
27. Принципы и задачи оценки эффективности проектов.
28. Методы и задачи отбора инвестиционного проекта.
29. Выбор и оптимизация инвестиционного проекта.
30. Способы снижения инвестиционных рисков.
31. Риск – анализ инвестиционного проекта.
32. Меры по уменьшению инвестиционных рисков.
33. Уровни инвестиционного риска.
34. Методы оценки инвестиционных рисков.
35. Теоретические основы оценки денежных потоков в инвестиционном анализе.
36. Понятие процента и методы его исчисления.
37. Методы учета временной ценности денег в финансовых расчетах.
38. Аннуитеты и методы оценки. Финансовые множители в расчетах.
39. Анализ цены и структуры капитала инвестиционного проекта.
40. Состав источников финансирования инвестиций.
41. Структура источников финансирования инвестиций.
42. Понятие капитала, его виды и их характеристика.
43. Пути формирования капитала предприятия, инвестиционного проекта.
44. Стоимость капитала и ее экономическое содержание.
45. Методы оценки стоимости капитала.
46. Расчет цены банковского кредита, нераспределенной прибыли, долговых обязательств.
47. Средневзвешенная цена капитала и пути ее минимизации.

48. Критерии выбора оптимальной структуры капитала инвестиционного проекта.
49. Статистические методы оценки эффективности инвестиций.
50. Методы оценки эффективности инвестиций, основанные на показателях денежного потока.
51. Оценка эффективности инвестиций в системе капитализации.
52. Понятие о доходности инвестиций.
53. Выбор ставки процента (дисконтной ставки).
54. Теоретические основы оценки денежных потоков в инвестиционном анализе.
55. Понятие денежного потока инвестиционного проекта.
56. Денежный поток от инвестиционной деятельности.
57. Денежный поток от операционной деятельности.
58. Сущность, основные принципы, лежащие в основе метода дисконтирования.
59. Область применения и ограничения метода.
60. Основные этапы оценки предприятия методом дисконтирования.
61. Учет влияния инфляции. Дефлирование.
62. Оптимизация денежного потока инвестиционного проекта.

Смысловой модуль 2. Методологические основы инвестиционного анализа.

1. Инвестиционная привлекательность и ее факторы.
2. Факторы, оказывающие влияние на инвестиционную деятельность: на макроуровне, на микроуровне.
3. Инвестиционная привлекательность отраслей экономики и регионов.
4. Показатели оценки инвестиционной привлекательности.
5. Инвестиционный потенциал российских регионов.
6. Инвестиционная привлекательность предприятий.
7. Кредитный рейтинг ценной бумаги.
8. Кредитный рейтинг компании.
9. Методы исчисления процента.
10. Методы учета временной ценности денег в финансовых расчетах.
11. Аннуитеты и методы оценки. Финансовые множители в расчетах.
12. Анализ цены и структуры капитала инвестиционного проекта.
13. Состав источников финансирования инвестиций.
14. Структура источников финансирования инвестиций.
15. Понятие капитала, его виды и их характеристика.
16. Пути формирования капитала предприятия, инвестиционного проекта.
17. Стоимость капитала и ее экономическое содержание.
18. Методы оценки стоимости капитала.
19. Расчет цены банковского кредита, нераспределенной прибыли, долговых обязательств.
20. Средневзвешенная цена капитала и пути ее минимизации.
21. Критерии выбора оптимальной структуры капитала инвестиционного проекта.
22. Инвестиционный проект и методы его оценки.
23. Содержание инвестиционного проекта.
24. Понятие и структура бизнес-плана.
25. Фазы инвестиционного проекта, их краткая характеристика.
26. Показатели оценки эффективности инвестиционных проектов: основанные на дисконтированных оценках, основанные на учетных оценках.
27. Сравнительная характеристика показателей эффективности инвестиционных проектов.
28. Анализ инвестиционных проектов в условиях инфляции.
29. Оценка инвестиций в финансовые вложения.
30. Фундаменталистская теория оценки стоимости финансового актива.
31. Понятие цены и стоимости финансового актива.
32. Оценка инвестиций в акции.
33. Модель Гордона.

34. Доходность акции и ее виды.
35. Оценка инвестиций в облигации.
36. Методы оценки стоимости различных видов облигаций.
37. Доходность облигации к погашению.
38. Оценка инвестиций в производные финансовые инструменты.
39. Сравнительная характеристика условий, влияющих на инвестиционное решение, при покупке фьючерсов, опционов.
40. Анализ формирования бюджета капиталовложений
41. Портфель капиталовложений и его содержание.
42. Подходы к формированию бюджета капиталовложений.
43. Предельная стоимость капитала.
44. Оптимизация бюджета капиталовложений: метод пространственной оптимизации, метод временной оптимизации.
45. Анализ инвестиционных рисков.
46. Инвестиционный риск: причины и предпосылки.
47. Характеристики инвестиционного риска.
48. Виды инвестиционных рисков.
49. Модели оценки инвестиционного риска.
50. Анализ инвестиционных проектов в условиях риска.
51. Имитационная модель риска.
52. Модель изменения денежных потоков.
53. Модель поправки на риск коэффициента дисконтирования.
54. Расчет и анализ экономической эффективности вариантов инвестиционного проекта.

Задача

Предприятие рассматривает проект, согласно которому необходимо приобрести оборудование, стоимость 35 тыс. руб. (амортизация начисляется равномерно). Срок реализации проекта 4 года.

Задача

В течение периода функционирования проекта запланирована продажа продукции. Ежедневный объем продаж – 1500 ед. продукции по цене 180 руб., себестоимость товара – 100 руб. за ед. Ставка дисконтирования составляет 12 %. Определите критерий чистой приведенной стоимости.

Проанализируйте, как изменится данный показатель, при условии, что объем реализации продукции увеличится на 15% в год.

Задача

Предприятие планирует приобрести оборудование, стоимость которого 225 тыс. руб. Стоимость монтажа – 3 тыс. руб. Ожидаемое увеличение оборотного капитала – 4 тыс. руб. Используя инвестирование проекта, предприятие снижает операционные расходы на 3,5 тыс. руб. и ожидает экономию 4 тыс. руб. в год на ремонтных работах. Новое оборудование нуждается в технической поддержке в размере 4 тыс. руб. Оборудование амортизируется в течение 7 лет. Ставка дисконтирования – 17 %. Рассчитайте денежный поток проекта.

Задача

Показатели	2017	2018
Объем продаж, тыс. руб.	4790	4990
Стоимость проданных товаров, тыс. руб.	2443	2537
Амортизация	975	1078
Оборотные средства на конец года, тыс. руб.	2140	2446
Чистые основные средства на конец года, тыс. руб.	6770	7187
Текущие обязательства	994	1156

Рассчитайте денежный поток проекта. Рассчитайте дисконтированный денежный поток проекта.

Задача

Предприятие оценивает 3 проекта. Денежные потоки каждого проекта приведены в таблице. Если стоимость капитала предприятия равна 17%, найдите лучший проект по критерию индекса доходности.

(тыс. руб.)

Год	Проект А	Проект В	Проект С
	-10000	-30000	-18000
1	2800	60000	6500
2	3000	10000	6500
3	4000	12000	6500
4	4000	16000	6500

Задача

Предполагаемый ежегодный доход от реализации проекта составит в первые три года 15 млн. руб., а в последующие два года – 10 млн. руб. Какова доходность проекта в современном масштабе цен, если ставка процента в первые три года составит 21% годовых, а затем 18% (ответ выразите в млн. руб. и округлите до десятых).

Задача

Какую сумму средств необходимо разместить в банке под 16% годовых для финансирования через 8 лет инвестиций в размере 32 млн. руб.: (ответ выразите в млн. руб. и округлите до десятых).

Задача

Инвестиционные затраты составляют 5,8 млн. руб., годовая величина чистого денежного потока ожидается в размере 720 тыс. р. Срок окупаемости капитальных вложений равен ___ лет.

Задача

Определите номинальную процентную ставку, если реальная доходность финансовых операций составляет 12%, а ожидаемая ставка инфляции – 8%:

Задача

На совместном предприятии предполагается освоить выпуск новой продукции, что потребует инвестиций в размере 12 млн. руб. в первый год и 3 млн. руб. во второй. Какой сумме будут соответствовать эти инвестиции спустя 5 лет после освоения новых мощностей при ставке процента 11?

Задача

Предполагаемый ежегодный доход от реализации проекта составит в первые четыре года 25 млн. руб., а в последующие два года – 35 млн. руб. Какова доходность проекта в современном масштабе цен, если ставка процента в первые четыре года составит 19 % годовых, а затем 18.

Задача

Какую сумму средств необходимо разместить в банке под 24% годовых для финансирования через 4 лет инвестиций в размере 15 млн. руб.

Задача

Инвестиционные затраты иностранного инвестора составляют 3,5 млн. руб., годовая величина чистого денежного потока ожидается в размере 960 тыс. р. Определите срок окупаемости капитальных вложений.

Задача

Коммерческая организация на четырехлетний период получает инвестиционный кредит в размере 950 тыс. р. Ежегодно планируется получать чистый денежный поток от реализации проекта в размере 230 тыс. руб. Определите с использованием срока окупаемости целесообразность реализации проекта в данных условиях финансирования.

Задача

С использованием формулы эффективной процентной ставки рассчитайте годовую величину инфляции, если индекс цен за три месяца составил 1,07.

Вопросы к контрольной работе (АПР)

1. Экономическая характеристика инвестиций, их необходимости и роли в экономике.
2. Характеристика нормативно-правовой базы инвестиционной деятельности.
3. Характеристика факторов инвестиционной привлекательности страны и региона.
4. Характеристика факторов инвестиционной привлекательности отрасли и предприятия.
5. Содержание инвестиционного процесса и его этапы.
6. Инвестиционный проект и его виды.
7. Субъекты и объекты инвестиций, их цели и задачи.
8. Виды ценных бумаг как объекты инвестиций, их сравнительная характеристика.
9. Виды капиталовложений и источники их финансирования.
10. Инвестиционная политика предприятия и ее этапы.
11. Цели и задачи инвестиционного анализа.
12. Характеристика информации необходимой для осуществления инвестиций.
13. Информационная база инвестиционного анализа и ее элементы.
14. Денежные потоки в инвестиционном анализе.
15. Оценка денежных потоков методами наращения и компаундинга.
16. Понятие процента и его использование в инвестиционных расчетах.
17. Аннуитет как вид денежного потока в инвестиционном проекте.
18. Структура бизнес-плана и его характеристика.
19. Характеристика источников финансирования инвестиционного проекта: преимущества и недостатки.
20. Оценка стоимости капитала в инвестиционном проекте.
21. Собственные ресурсы как источник инвестиций: характеристика, оценка.
22. Заемные средств привлеченных инвесторов: виды и стоимость.
23. Динамические методы оценки эффективности инвестиционного проекта.
24. Учетные оценки эффективности инвестиционного проекта.
25. Методы оценки эффективности капитальных вложений.
26. Методы оценки эффективности финансовых вложений.
27. Инвестиционный портфель: характеристика и виды.
28. Инфляция и ее влияние на эффективность инвестиций.
29. Риск в инвестиционном процессе и методы его оценки.
30. Методы формирования портфеля капиталовложений и их характеристика.
31. Понятие инвестиционного риска и его значение в инвестиционном процессе.
32. Управление рисками на рынке ценных бумаг.
33. Доходность и риск инвестиций: понятие, оценка.
34. Система показателей оценки эффективности инвестиций.
35. Анализ инвестиционных доходов и расходов: характеристика, методы.

36. Налоговые показатели в инвестиционном проекте: характеристика, методы расчета.

37. Причины инвестиций и их необходимость.

38. Инвестиционные фонды на рынке: особенности, цели и задачи.

39. Государственное регулирование инвестиционной деятельности в государстве.

40. Степень развитости инвестиционной деятельности в России и дальнейшие перспективы.

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Инвестиционный анализ: история развития, сущность и основные задачи.
2. Цели, задачи и содержание инвестиционного анализа.
3. Функции инвестиционного анализа.
4. Принципы инвестиционного анализа.
5. Факторы, осложняющие принятие инвестиционного решения.
6. Сущность инвестиционного планирования и его использование в практике.
7. Экономическая сущность инвестиций, инвестиционного процесса и инвестиционной политики.
8. Классификация видов инвестиций.
9. Субъекты и объекты инвестиционной деятельности.
10. Формы реальных инвестиций.
11. Источники капитальных вложений.
12. Инвестиционный процесс и его участники.
13. Процесс разработки и формирования инвестиционной политики.
14. Сущность и виды инвестиционных проектов.
15. Принципы и задачи оценки эффективности проектов.
16. Методы и задачи отбора инвестиционного проекта.
17. Выбор и оптимизация инвестиционного проекта.
18. Меры по уменьшению инвестиционных рисков.
19. Методы оценки инвестиционных рисков.
20. Теоретические основы оценки денежных потоков в инвестиционном анализе.
21. Методы учета временной ценности денег в финансовых расчетах.
22. Аннуитеты и методы оценки. Финансовые множители в расчетах.
23. Анализ цены и структуры капитала инвестиционного проекта.
24. Состав источников финансирования инвестиций.
25. Структура источников финансирования инвестиций.
26. Понятие капитала, его виды и их характеристика.
27. Пути формирования капитала предприятия, инвестиционного проекта.
28. Стоимость капитала и ее экономическое содержание.
29. Методы оценки стоимости капитала.
30. Расчет цены банковского кредита, нераспределенной прибыли, долговых обязательств.
31. Средневзвешенная цена капитала и пути ее минимизации.
32. Критерии выбора оптимальной структуры капитала инвестиционного проекта.
33. Статистические методы оценки эффективности инвестиций.
34. Методы оценки эффективности инвестиций, основанные на показателях денежного потока.
35. Оценка эффективности инвестиций в системе капитализации.
36. Понятие о доходности инвестиций.
37. Выбор ставки процента (дисконтной ставки).
38. Теоретические основы оценки денежных потоков в инвестиционном анализе.
39. Понятие денежного потока инвестиционного проекта.
40. Денежный поток от инвестиционной деятельности.
41. Денежный поток от операционной деятельности.
42. Сущность, основные принципы, лежащие в основе метода дисконтирования.

43. Область применения и ограничения метода.
44. Основные этапы оценки предприятия методом дисконтирования.
45. Учет влияния инфляции. Дефлирование.
46. Оптимизация денежного потока инвестиционного проекта.
47. Инвестиционная привлекательность и ее факторы.
48. Факторы, оказывающие влияние на инвестиционную деятельность: на макроуровне, на микроуровне.
49. Инвестиционная привлекательность отраслей экономики и регионов.
50. Показатели оценки инвестиционной привлекательности.
51. Инвестиционный потенциал российских регионов.
52. Инвестиционная привлекательность предприятий.
53. Кредитный рейтинг ценной бумаги.
54. Кредитный рейтинг компании.
55. Методы исчисления процента.
56. Методы учета временной ценности денег в финансовых расчетах.
57. Аннуитеты и методы оценки. Финансовые множители в расчетах.
58. Анализ цены и структуры капитала инвестиционного проекта.
59. Состав источников финансирования инвестиций.
60. Структура источников финансирования инвестиций.
61. Понятие капитала, его виды и их характеристика.
62. Пути формирования капитала предприятия, инвестиционного проекта.
63. Стоимость капитала и ее экономическое содержание.
64. Методы оценки стоимости капитала.
65. Расчет цены банковского кредита, нераспределенной прибыли, долговых обязательств.
66. Средневзвешенная цена капитала и пути ее минимизации.
67. Критерии выбора оптимальной структуры капитала инвестиционного проекта.
68. Инвестиционный проект и методы его оценки.
69. Содержание инвестиционного проекта.
70. Понятие и структура бизнес-плана.
71. Фазы инвестиционного проекта, их краткая характеристика.
72. Показатели оценки эффективности инвестиционных проектов: основанные на дисконтированных оценках, основанные на учетных оценках.
73. Сравнительная характеристика показателей эффективности инвестиционных проектов.
74. Анализ инвестиционных проектов в условиях инфляции.
75. Оценка инвестиций в финансовые вложения.
76. Фундаменталистская теория оценки стоимости финансового актива.
77. Понятие цены и стоимости финансового актива.
78. Оценка инвестиций в акции.
79. Модель Гордона.
80. Доходность акции и ее виды.
81. Оценка инвестиций в облигации.
82. Методы оценки стоимости различных видов облигаций.
83. Доходность облигации к погашению.
84. Оценка инвестиций в производные финансовые инструменты.
85. Сравнительная характеристика условий, влияющих на инвестиционное решение, при покупке фьючерсов, опционов.
86. Анализ формирования бюджета капиталовложений
87. Портфель капиталовложений и его содержание.
88. Подходы к формированию бюджета капиталовложений.
89. Предельная стоимость капитала.
90. Оптимизация бюджета капиталовложений: метод пространственной оптимизации, метод временной оптимизации.

91. Анализ инвестиционных рисков.
92. Инвестиционный риск: причины и предпосылки.
93. Характеристики инвестиционного риска.
94. Виды инвестиционных рисков.
95. Модели оценки инвестиционного риска.
96. Анализ инвестиционных проектов в условиях риска.
97. Имитационная модель риска.
98. Модель изменения денежных потоков.
99. Модель поправки на риск коэффициента дисконтирования.
100. Расчет и анализ экономической эффективности вариантов инвестиционного проекта.

Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков

Текущий контроль знаний обучающихся осуществляется на основании оценки систематичности и активности по каждой теме программного материала учебной дисциплины. Текущий контроль знаний обучающихся осуществляется с помощью собеседования, подготовки реферата, тестирования, решения разноуровневых задач и заданий, выполнения контрольной работы по результатам изучения смыслового модуля.

Собеседование осуществляется по лекционному материалу и материалу для самостоятельного изучения обучающимся. Развернутый ответ обучающегося должен представлять собой связное, логически последовательное сообщение на заданную тему, показывать его умение применять определения, правила в конкретных случаях.

Тест – это система контрольных заданий определенной формы и содержания, позволяющих объективно оценить уровень знаний по теме, разделу или учебной дисциплине в целом. Представленные тестовые задания по каждой теме позволяют оценить уровень знаний студентов и имеют только один верный ответ.

Выполнение обучающимся разноуровневых задач и заданий направлено на:

- обобщение, систематизацию, углубление, закрепление полученных теоретических знаний по конкретным темам учебной дисциплины;
- формирование умений применять полученные знания на практике, реализацию единства интеллектуальной и практической деятельности;
- развитие интеллектуальных аналитических умений обучающихся;
- выработку при решении разноуровневых задач и заданий таких профессионально значимых качеств, как самостоятельность, ответственность, точность, творческая инициатива.

Разноуровневые задачи и задания предполагают решение задач разного уровня, расчет и анализ различных показателей, составление и анализ формул, обработка результатов проведенных расчетов, составление таблиц и схем.

По результатам изучения смыслового модуля проводится контрольная работа.

Промежуточная аттестация осуществляется в форме экзамена.