

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 30.07.2024 13:46:33

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Метакafедра (УМУ)

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.06 Инвестиционный анализ

Основная профессиональная образовательная программа 01.03.05 Статистика программа Бизнес-аналитика

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Самара 2024

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Метакафедра (УМУ)

АННОТАЦИЯ

Наименование дисциплины Б1.В.06 Инвестиционный анализ

Основная профессиональная образовательная программа 01.03.05 Статистика программа Бизнес-аналитика

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Метакafедра (УМУ)

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета
(протокол № от 30 мая 2024 г.)

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

Наименование дисциплины Б1.В.06 Инвестиционный анализ

Основная профессиональная образовательная программа 01.03.05 Статистика программа Бизнес-аналитика

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Содержание (ФОС)

Стр.

- 6.1 Контрольные мероприятия по дисциплине
- 6.2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 6.3 Паспорт оценочных материалов
- 6.4 Оценочные материалы для текущего контроля
- 6.5 Оценочные материалы для промежуточной аттестации
- 6.6 Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Инвестиционный анализ входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Экономическая теория, Экономика организации, Основы учета и финансовой отчетности, Основы финансовых расчетов, Финансовая и налоговая система РФ, Бизнес-планирование, Финансовый рынок, Теория отраслевых рынков, Методы многомерного статистического анализа, Микроэкономическая статистика, Анализ временных рядов и прогнозирование, Консультационный проект

Последующие дисциплины по связям компетенций: Корпоративные финансы, Оценка стоимости бизнеса, Статистика видов экономической деятельности, Современные технологии рыночной аналитики, Математико-статистические методы в демографии, Основы актуарных расчетов, Статистические методы принятия управленческих решений, Теория игр, Статистика окружающей среды, Статистические методы управления качеством, Региональная и муниципальная статистика, Управление рисками

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Инвестиционный анализ в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Универсальные компетенции (УК):

УК-10 - Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|---|--|---|
| УК-10 | УК-10.1: Знать: | УК-10.2: Уметь: | УК-10.3: Владеть (иметь навыки): |
| | основные законы и закономерности функционирования экономики; основы экономической теории; правила и последствия принятия экономических решений в различных областях жизнедеятельности | применять экономические знания при выполнении практических задач; принимать грамотные и обоснованные экономические решения | методами принятия обоснованных экономических решений в различных областях жизнедеятельности; основными положениями и методами при решении социальных и профессиональных задач |

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен проводить анализ информации с применением математического аппарата, цифрового статистического и эконометрического инструментария и специализированного программного обеспечения для решения профессиональных задач; разрабатывать прогнозы и сценарии развития общественных явлений и социально-экономических процессов

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|---|--------------------------------------|--|
| ПК-2 | ПК-2.1: Знать: | ПК-2.2: Уметь: | ПК-2.3: Владеть (иметь навыки): |
| | математико-статистические методы | разрабатывать и обосновывать систему | навыками построения моделей и прогнозных |

| | | | |
|--|--|--|--|
| | анализа общественных явлений и социально-экономических процессов | статистических показателей, применять математический аппарат и специализированное программное обеспечение для решения профессиональных задач | сценариев развития общественных явлений и процессов на основе пространственной и временной информации с использованием цифровых технологий |
|--|--|--|--|

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

| Виды учебной работы | Всего час/ з.е. |
|--|-----------------|
| | Сем 6 |
| Контактная работа, в том числе: | 74.3/2.06 |
| Занятия лекционного типа | 36/1 |
| Занятия семинарского типа | 36/1 |
| Индивидуальная контактная работа (ИКР) | 0.3/0.01 |
| Групповая контактная работа (ГКР) | 2/0.06 |
| Самостоятельная работа: | 71.7/1.99 |
| Промежуточная аттестация | 34/0.94 |
| Вид промежуточной аттестации: Экзамен | Экз |
| Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы | 180 |
| Зачетные единицы | 5 |

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Инвестиционный анализ представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий

Очная форма обучения

| № п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Контактная работа | | | | Самостоятельная работа | Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе | |
|-------|--|-------------------|---------------------------|------------|----------|------------------------|--|-----|
| | | Лекции | Занятия семинарского типа | | ИКР | | | ГКР |
| | | | Практич. занятия | | | | | |
| 1. | Основы инвестиционного анализа | 18 | 18 | | | 36 | УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | |
| 2. | Оценка эффективности инвестиционных проектов | 18 | 18 | | | 35.7 | УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | |
| | Контроль | 34 | | | | | | |
| | Итого | 36 | 36 | 0.3 | 2 | 71.7 | | |

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

| №п/п | Наименование темы | Вид занятия | Тематика занятия лекционного типа |
|------|-------------------|-------------|-----------------------------------|
|------|-------------------|-------------|-----------------------------------|

| | (раздела) дисциплины | лекционного типа* | |
|----|--|-------------------|---|
| 1. | Основы инвестиционного анализа | лекция | Сущность, функции и основные задачи инвестиционного анализа |
| | | лекция | Направления инвестиционного анализа |
| | | лекция | Методы осуществления инвестиционного анализа |
| | | лекция | Анализ структуры капитала инвестиционного проекта |
| | | лекция | Инвестиционное бизнес-проектирование. |
| | | лекция | Анализ инвестиционных рисков. |
| | | лекция | Современные методы оценки инвестиций |
| | | лекция | Использование автоматизированных технологий в инвестиционном анализе |
| | | лекция | Анализ как элемент управления проектами |
| 2. | Оценка эффективности инвестиционных проектов | лекция | Инвестиционный проект как объект анализа. |
| | | лекция | Основные направления проектного анализа: технический, коммерческий, экономический, организационный, экологический, социальный анализ. |
| | | лекция | Показатели, применяемые в анализе коммерческой состоятельности и экономической эффективности инвестиционного проекта. |
| | | лекция | Анализ влияния внутренних и внешних факторов на выбор ставки дисконтирования. |
| | | лекция | Анализ взаимосвязанных и взаимоисключающих инвестиционных проектов |
| | | лекция | . Методология бизнес-проектирования. Бизнес-план инвестиционного проекта |
| | | лекция | Структура бизнес-плана. Основные принципы его разработки. |
| | | лекция | Структура капитала инвестиционного проекта. Стоимость различных источников капитала |
| | | лекция | . Выбор структуры капитала и ее влияние на осуществимость инвестиций. Оптимизация структуры капитала при инвестировании |

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

| №п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Вид занятия семинарского типа** | Тематика занятия семинарского типа |
|------|--|---------------------------------|------------------------------------|
|------|--|---------------------------------|------------------------------------|

| | | | |
|----|--|----------------------|---|
| 1. | Основы инвестиционного анализа | практическое занятие | Сущность, функции и основные задачи инвестиционного анализа |
| | | практическое занятие | Направления инвестиционного анализа |
| | | практическое занятие | Методы осуществления инвестиционного анализа |
| | | практическое занятие | Анализ структуры капитала инвестиционного проекта |
| | | практическое занятие | Инвестиционное бизнес-проектирование. |
| | | практическое занятие | Анализ инвестиционных рисков. |
| | | практическое занятие | Современные методы оценки инвестиций |
| | | практическое занятие | Использование автоматизированных технологий в инвестиционном анализе |
| | | практическое занятие | Анализ как элемент управления проектами |
| 2. | Оценка эффективности инвестиционных проектов | практическое занятие | Инвестиционный проект как объект анализа. |
| | | практическое занятие | Основные направления проектного анализа: технический, коммерческий, экономический, организационный, экологический, социальный анализ. |
| | | практическое занятие | Показатели, применяемые в анализе коммерческой состоятельности и экономической эффективности инвестиционного проекта. |
| | | практическое занятие | Анализ влияния внутренних и внешних факторов на выбор ставки дисконтирования. |
| | | практическое занятие | Анализ взаимосвязанных и взаимоисключающих инвестиционных проектов |
| | | практическое занятие | . Методология бизнес-проектирования. Бизнес-план инвестиционного проекта |
| | | практическое занятие | Структура бизнес-плана. Основные принципы его разработки. |
| | | практическое занятие | Структура капитала инвестиционного проекта. Стоимость различных источников капитала |
| | | практическое занятие | . Выбор структуры капитала и ее влияние на осуществимость инвестиций. Оптимизация структуры капитала при инвестировании |

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

| №п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Вид самостоятельной работы *** |
|------|--|--|
| 1. | Основы инвестиционного анализа | - подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование |
| 2. | Оценка эффективности инвестиционных проектов | - подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование |

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Касьяненко, Т. Г. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 560 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17411-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/538794>
2. Румянцева, Е. Е. Инвестиционный анализ : учебное пособие для вузов / Е. Е. Румянцева. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 281 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10389-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/538215>
Ример М. И. Экономическая оценка инвестиций: Учебник для вузов. 4-е изд., переработанное и дополненное (+CD с учебными материалами) / М.И. Ример. - Санкт-Петербург : Питер, 2021. - 432 с. - ISBN 978-5-4461-9444-5. - URL: <https://ibooks.ru/bookshelf/378777/reading>

Дополнительная литература

1. Кузнецов, Б. Т. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов / Б. Т. Кузнецов. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 363 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02215-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536003>
- Борисова, О. В. Инвестиции : учебник и практикум для вузов / О. В. Борисова, Н. И. Малых, Л. В. Овешникова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 482 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17337-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/542657>

Литература для самостоятельного изучения

- 1.

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

| | |
|---|---|
| Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа | Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран |
| Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа) | Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций | Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации | Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Помещения для самостоятельной работы | Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования | Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования |

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Инвестиционный анализ:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

| Вид контроля | Форма контроля | Отметить нужное знаком «+» |
|------------------|---|----------------------------|
| Текущий контроль | Оценка докладов | - |
| | Устный/письменный опрос | - |
| | Тестирование | + |
| | Практические задачи | + |
| | Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения) | - |

| | | |
|------------------------|---------|---|
| Промежуточный контроль | Экзамен | + |
|------------------------|---------|---|

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Универсальные компетенции (УК):

УК-10 - Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|---|--|---|
| | | УК-10.1: Знать: | УК-10.2: Уметь: |
| | основные законы и закономерности функционирования экономики; основы экономической теории; правила и последствия принятия экономических решений в различных областях жизнедеятельности | применять экономические знания при выполнении практических задач; принимать грамотные и обоснованные экономические решения | методами принятия обоснованных экономических решений в различных областях жизнедеятельности; основными положениями и методами при решении социальных и профессиональных задач |
| Пороговый | основные законы и закономерности функционирования экономики | применять экономические знания при выполнении практических задач | методами принятия обоснованных экономических решений в различных областях жизнедеятельности |
| Стандартный (в дополнение к пороговому) | основы экономической теории; | принимать грамотные экономические решения | основными положениями решения социальных и профессиональных задач |
| Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному) | правила и последствия принятия экономических решений в различных областях жизнедеятельности | принимать обоснованные экономические решения | основными методами при решении социальных и профессиональных задач |

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен проводить анализ информации с применением математического аппарата, цифрового статистического и эконометрического инструментария и специализированного программного обеспечения для решения профессиональных задач; разрабатывать прогнозы и сценарии развития общественных явлений и социально-экономических процессов

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине | | |
|--|---|--------------------------------------|--|
| | | ПК-2.1: Знать: | ПК-2.2: Уметь: |
| | математико-статистические методы | разрабатывать и обосновывать систему | навыками построения моделей и прогнозных |

| | | | |
|--|--|--|--|
| | анализа общественных явлений и социально-экономических процессов | статистических показателей, применять математический аппарат и специализированное программное обеспечение для решения профессиональных задач | сценариев развития общественных явлений и процессов на основе пространственной и временной информации с использованием цифровых технологий |
| Пороговый | математико-статистические методы анализа | разрабатывать и обосновывать систему статистических показателей | навыками построения моделей развития общественных явлений |
| Стандартный (в дополнение к пороговому) | математико-статистические методы анализа общественных явлений | применять математический аппарат обеспечение для решения профессиональных задач | навыками построения моделей и прогнозных сценариев развития общественных явлений и процессов на основе пространственной и временной информации |
| Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному) | статистические методы анализа социально-экономических процессов | применять специализированное программное обеспечение для решения профессиональных задач | с использованием цифровых технологий |

6.3. Паспорт оценочных материалов

| № п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе | Вид контроля/используемые оценочные средства | |
|-------|--|---|--|---------------|
| | | | Текущий | Промежуточный |
| 1. | Основы инвестиционного анализа | УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | Тестирование Практические задачи | Экзамен |
| 2. | Оценка эффективности инвестиционных проектов | УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 | Тестирование Практические задачи | Экзамен |

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами

<https://lms2.sseu.ru/enrol/index.php?id=27968>

1. Дайте определение понятия «инвестиции»:

а) процесс вложения средств в основной капитал;

б) вложение в ценные бумаги;

в) процесс, в ходе которого осуществляется преобразование ресурсов в затраты с учетом целевых установок инвесторов.

2. Какие стадии оборота средств включает в себя инвестиционная деятельность:

б) период времени, в течение которого реализуются цели, поставленные в проекте;

в) период времени эксплуатации созданных объектов.

9. Что понимается под экономической эффективностью инвестиционного проекта:

а) влияние реализации проекта на доходы и расходы федерального, регионального или местного бюджета;

б) эффективность использования в инвестиционном проекте бюджетных средств;

в) воздействие процесса реализации инвестиционного проекта на внешнюю для проекта среду.

10. Что понимается под коммерческой эффективностью инвестиционного проекта:

а) финансовые последствия реализации проекта для ее непосредственных участников;

б) эффективность использования в инвестиционном проекте бюджетных средств;

в) воздействие процесса реализации инвестиционного проекта на внешнюю для проекта среду.

11. Какая величина сальдо накопленных реальных денег является необходимым условием принятия инвестиционного проекта:

а) отрицательная; б) равная нулю; в) положительная.

12. Будущая стоимость текущего капитала рассчитывается методом:

а) дисконтирования; б) начисления процентов.

13. Дисконтирование — это:

а) приведение будущей стоимости к современной величине;

б) приведение текущей стоимости к будущей величине.

14. Чистый дисконтированный доход от инвестиционного проекта — это:

а) разница между проектным доходом и проектными затратами;

б) разница между дисконтированным доходом и дисконтированными затратами;

в) дисконтированный поток денежных средств.

15. Внутренняя норма доходности инвестиционного проекта — это ставка дисконта, обеспечивающая:

а) максимальный чистый приведенный доход;

б) равенство приведенных доходов и приведенных затрат;

в) минимальный чистый приведенный убыток.

16. Одна из положительных характеристик инвестиционного проекта:

а) высокая внутренняя норма доходности;

б) низкая внутренняя норма доходности.

17. Какой из перечисленных видов ценных бумаг обладает высокой ликвидностью:

а) привилегированные акции;

в) беззакладные облигации;

б) закладные облигации;

г) конвертируемые облигации.

18. Общие инвестиционные риски – это:

а) совокупность рисков, одинаковых для всех участников инвестиционной деятельности и форм инвестирования;

б) совокупность рисков по отдельному инвестиционному портфелю;

в) совокупность рисков, присущих отдельному инвестору.

19. Риск инвестиционного портфеля, связанный с общим ухудшением его качества, который показывает возможность потерь при вложении в инвестиции по сравнению с другими видами активов – это:

а) риск несбалансированности;

в) селективный риск;

б) риск излишней концентрации;

г) капитальный риск.

20. Какой из перечисленных инвестиционных рисков не относится к рискам объектов инвестирования:

а) отраслевой риск;

в) инфляционный риск;

б) временной риск;

г) риск ликвидности.

21. Фондовый инструмент характеризуется низким уровнем риска при значении коэффициента β :

а) $\beta = 1$;

б) $\beta > 1$;

в) $\beta < 1$.

22. Доходность облигации определяется:

а) купонными выплатами;

б) вознаграждением за предоставленный эмитенту заем и разницей между ценой погашения и приобретения бумаги;

в) дивидендами;

г) получением части распределяемой прибыли АО и возможностью продать бумагу на фондовой

бирже по цене, большей цены приобретения.

23. Доходность акции определяется:

- а) купонными выплатами;
- б) вознаграждением за предоставленный эмитенту заем и разницей между ценой погашения и приобретения бумаги;
- в) дивидендами;
- г) получением части распределяемой прибыли АО и возможностью продать бумагу на фондовой бирже по цене, большей цены приобретения.

24. Отбор объектов инвестирования по критерию доходности (эффективности) осуществляется на основании расчета:

- а) рентабельности инвестиций;
- б) суммарного чистого приведенного дохода инвестиционного портфеля;
- в) внутренней нормы доходности.

25. Отбор инвестиционных объектов по критерию ликвидности осуществляется исходя из оценки:

- а) времени трансформации инвестиций в денежные средства;
- б) степени реализуемости инвестиций;
- в) времени трансформации инвестиций в денежные средства и размера финансовых потерь инвестора, связанных с этой трансформацией.

26. К привлеченным источникам финансирования инвестиционных проектов относятся:

- а) средства, полученные от эмиссии акций, паевые и иные взносы юридических и физических лиц в уставный (складочный) капитал;
- б) средства, полученные от эмиссии облигаций, банковские кредиты;
- в) паевые и иные взносы юридических и физических лиц в уставный (складочный) капитал, бюджетные ассигнования.

27. Стоимость привлечения инвестиционных ресурсов – это:

- а) прибыль, полученная в результате привлечения инвестиционных ресурсов;
- б) затраты на привлечение источников капитала;
- в) сумма привлеченных инвестиционных ресурсов.

28. Какая структура инвестиционных ресурсов является оптимальной для инвестора (традиционный подход)?

- а) структуру инвестиционных ресурсов нельзя оптимизировать;
- б) при которой средневзвешенная стоимость инвестиционных ресурсов будет максимальна;
- в) при которой средневзвешенная стоимость инвестиционных ресурсов будет минимальна.

29. При проектировании в две стадии они называются:

- а) предпроектная стадия и проект;
- б) рабочие чертежи и проектно-сметная документация;
- в) рабочий проект и документация;
- г) проект и рабочая документация.

30. Проект необходим для:

- а) выполнения строительно-монтажных работ по запроектированному объекту;
- б) установления возможности и целесообразности сооружения объекта;
- в) заключения договора подряда.

31. В одну стадию осуществляется проектирование:

- а) индивидуальных жилых и общественных зданий при условии, что это технически несложные объекты, проекты типовых зданий;
- б) крупных жилых, общественных и промышленных зданий;
- в) объекты жилищно-гражданского назначения, базы строительной индустрии.

32. Какие инвестиционные проекты подлежат государственной экспертизе:

- а) все инвестиционные проекты независимо от источников финансирования и форм собственности;
- б) инвестиционные проекты, имеющие бюджетное финансирование;
- в) инвестиционные проекты, заказчиками которых выступают государственные организации.

33. При каком методе финансирования инвестиционных проектов капитальные вложения осуществляют за счет собственных средств предприятия (чистой прибыли, амортизационных отчислений и др.):

- а) бюджетное финансирование;
- б) самофинансирование;
- в) акционирование;

| | |
|--|--|
| | <p>17. Экспресс-анализ инвестиционного проекта: направления, показатели, технология.</p> <p>18. Показатели, применяемые в анализе коммерческой состоятельности и экономической эффективности инвестиционного проекта</p> <p>19. Анализ влияния внутренних и внешних факторов на выбор ставки дисконтирования.</p> <p>20. Анализ взаимосвязанных и взаимоисключающих инвестиционных проектов</p> <p>21. Влияние факторов риска на инвестиционные проекты.</p> <p>22. Инвестиционный риск и его виды.</p> <p>23. Вероятностный подход к оценке риска инвестиционного проекта.</p> <p>24. Имитационная модель оценки риска.</p> <p>25. Методика изменения денежного потока.</p> <p>26. Влияние риска на чистую текущую стоимость проекта.</p> <p>27. Модель поправки на риск ставки дисконта.</p> <p>28. Управление проектным риском.</p> <p>29. Методика построения безрискового эквивалента денежного потока.</p> <p>30. Методика поправки на риск коэффициента дисконтирования.</p> <p>31. Содержание анализа финансовых инвестиций.</p> <p>32. Характеристика источников финансирования инвестиций.</p> <p>33. Анализ состава и структуры источников финансирования инвестиций.</p> <p>34. Цена основных источников капитала.</p> <p>35. Анализ инвестиций на основе СВА</p> <p>36. Использование модели денежной добавленной стоимости (CVA)</p> <p>37. Методика эколого-экономической оценки.</p> <p>38. Технология проведения Due Diligence</p> <p>39. Оценка некоммерческих инвестиционных проектов.</p> <p>40. Обзор автоматизированных технологий инвестиционного анализа</p> |
|--|--|

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

| Оценка | Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы |
|-----------------------|---|
| «отлично» | Повышенный УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| «хорошо» | Стандартный УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| «удовлетворительно» | Пороговый УК-10.1, УК-10.2, УК-10.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3 |
| «неудовлетворительно» | Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне |