

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ЗАБАЙКАЛЬСКИЙ АГРАРНЫЙ ИНСТИТУТ – филиал ФГБОУ ВО
«Иркутский государственный аграрный университет
имени А.А. Ежевского»

Экономический факультет

Кафедра экономики и менеджмента

Инвестиционная стратегия

Методические указания и задания
для выполнения самостоятельной и контрольной работы
для студентов второго курса заочной формы обучения
Экономического факультета по направлению подготовки
38.03.01 – «Экономика» профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит»

Чита 2017

ББК 65.27

Ш 35

Методические указания и задания для выполнения самостоятельной и контрольной работы для студентов четвертого курса заочной формы обучения экономического факультета по направлению 38.03.01 – «Экономика» профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит».

Составитель: к.э.н., доцент Н.В. Щукина

Рецензенты: к.э.н., Т.Ю. Панина

Рассмотрено на заседании кафедры экономики и менеджмента ЗабАИ и рекомендовано к изданию « 23 » января 2017г. Протокол № 5

Утверждено Методической комиссией экономического факультета ЗабАИ « 27 » января 2017 г., протокол № 1

Методические указания предназначены для студентов четвертого курса заочной формы обучения и предусматривают освоение курса знаний теоретического и прикладного характеров. В методических указаниях определены цель и задачи выполнения контрольной работы, требования к содержанию, структуре и оформлению.

Методические указания соответствуют требованиям ФГОС ВО и примерной учебной программе дисциплины: по направлению 38.03.01– «Экономика» профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит».

© Е.Н. Швецова, 2017

© ЗабАИ, 2017

Пояснительная записка

Методические указания и задания для выполнения самостоятельной и контрольной работы составлены в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования.

Контрольную работу по дисциплине «Инвестиционная стратегия» выполняют студенты четвертого курса заочной формы обучения по направлению 38.03.01 «Экономика» профиль «Бухгалтерский учет, анализ и аудит».

Цель дисциплины - формирование целостных представлений о теории и практике страхования.

Содержание

Введение.....	5
1.Цель и задачи освоения дисциплины.....	6
2. Место дисциплины в структуре ОП бакалавриата	6
3. Компетенции студента, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля).....	6
4.Структура дисциплины (модуля)	7
5. Содержание дисциплины (модуля)	8
6. Требования к написанию и оформлению контрольной работы	10
7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	21

Введение

Контрольная работа – индивидуальная самостоятельная работа студента в учебном процессе по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль Бухгалтерский учет, анализ и аудит.

Она является формой итогового контроля знаний, полученных во время аудиторных занятий и самостоятельной работы. Контрольная работа является завершающим этапом изучения дисциплины «Инвестиционная стратегия».

Целью написания контрольной работы по дисциплине «Инвестиционная стратегия» является систематизация, закрепление и расширение знаний на основе самостоятельного изучения и обобщения научной и учебной литературы, а также развитие у студентов умения применять научный метод, методологию системного подхода для решения конкретных задач.

1. Цель и задачи освоения дисциплины

Целью дисциплины «Инвестиционная стратегия» является формирование современных знаний в области стратегического планирования инвестиций, раскрытие сущностных основ взаимодействия теории и практики формирования инвестиционной стратегии на уровне предприятия, роли и значения инвестиционной стратегии в современных рыночных условиях.

Задачи освоения дисциплины:

- формирование представления об инвестиционной стратегии как одного из разделов экономической стратегии;
- освоение новых подходов к оценке инвестиционной привлекательности отраслей и регионов;
- изучение порядка формирования инвестиционной стратегии на уровне предприятия;
- изучение современных методик оценки эффективности реальных проектов и оценки качеств финансовых инструментов.

2. Место дисциплины в структуре ОП бакалавриата

Дисциплина «Инвестиционная стратегия» находится в вариативной части блока 1 учебного плана дисциплина по выбору. Приступая к изучению данной дисциплины, студент должен иметь базовые знания по следующим дисциплинам: «Методы принятия управленческих решений», «Корпоративные финансы», «Финансовый менеджмент», «Маркетинг».

Знания и умения, полученные в результате освоения дисциплины, являются необходимыми для прохождения производственной практики.

3. Компетенции студента, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся общепрофессиональных (ОПК) компетенций, представленных в таблице 1.

Таблица 1 - Требования к результатам освоения учебной дисциплины

Трудовое действие	Наименование компетенции, необходимой для выполнения трудового действия (планируемые результаты освоения ОП)	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенции
--------------------------	---	--

Общепрофессиональные компетенции		
	ОПК-3 – способностью выбирать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы	В области знания и понимания (А)
		Знать: инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей
		В области интеллектуальных навыков (В)
		Уметь: выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы
		В области практических умений (С)
		Владеть: способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы

4. Структура дисциплины (модуля)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы 144 часа.

Таблица 2 – Трудоемкость дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Объем часов / зачетных единиц	Объем часов / зачетных единиц
	всего	4 курс
Общая трудоемкость дисциплины	144/4	144/4
Контактная работа обучающихся с преподавателем (всего)	14	14
в том числе:		
Лекции (Л)	6	6
Семинарские занятия (СЗ)	8	8
Лабораторные работы (ЛР)	-	-

Самостоятельная работа:	126	126
Контрольная работа	26	26
Самостоятельное изучение разделов	50	50
Самоподготовка	50	50
Подготовка и сдача зачета с оценкой	4	4

5. Содержание дисциплины (модуля)

Таблица 3 - Разделы дисциплины и виды занятий

№ п/п	Разделы дисциплины	Кол-во часов по видам занятий			
		лекции	практич. занятия	сам. работа	Формы текущего контроля
1	Тема 1. Основные категории инвестиционной деятельности	1	-	21	Устный опрос
2	Тема 2. Инвестиционный климат в России как макроэкономический фактор повышения инвестиционной активности	1	-	21	Устный опрос
3	Тема 3. Теоретические и методические основы управления инвестированием	1	2	21	Устный опрос
4	Тема 4. Содержание процесса стратегического управления инвестициями и формирование инвестиционной стратегии предприятия	1	2	21	Устный опрос
5	Тема 5. Стратегическое управление ресурсами предприятия в процессе инвестирования	1	2	21	Устный опрос
6	Тема 6. Анализ инвестиционных решений с использованием компьютерных технологий	1	2	21	Устный опрос
	Итого	6	8	126	Контрольная работа, Зачет с оценкой

Таблица 4 – Тематическое содержание дисциплины

№ п/п	Тема и краткое содержание темы	
1	Раздел 1	1. Тема 1: Основные категории инвестиционной деятельности. Сущность инвестиций и их экономическое значение. Многообразие понятий термина «инвестиции» в современной отечественной и зарубежной литературе. Особенности инвестиционной деятельности предприятия. Основные принципы управления инвестиционной деятельностью. Классификация инвестиционных проектов. Субъекты и объекты инвестиций. Инвесторы. Заказчики. Подрядчики. Пользователи. Классификация инвесторов
2		Тема 2: Инвестиционный климат в России как макроэкономический фактор повышения инвестиционной активности.

		<p>Основные подходы к определению понятия «инвестиционный климат» страны. Сущность инвестиционного климата страны, его составляющие и критерии отнесения к той или иной группе. Методики оценки уровня инвестиционного климата страны. Методики балльной оценки. Инвестиционный климат региона, его структурные составляющие. Понятие «региональный инвестиционный климат». Инвестиционный потенциал. Элементы инвестиционного климата региона. Инвестиционный рис</p>
3	Раздел 2	<p>Тема 3: Теоретические и методические основы управления инвестированием. Сущность, цели и задачи инвестиционного менеджмента. Подготовка и принятие управленческих решений, связанных с инвестированием капитала на уровне предприятия. Место инвестиционного менеджмента в общей системе управления предприятием. Группировка основных функций инвестиционного менеджмента. Характеристика основных элементов механизма инвестиционного менеджмента. Основы организации инвестиционного менеджмента в рамках структуры управления предприятием. Информационное обеспечение инвестиционного менеджмента: основные пользователи инвестиционной информации, система показателей информационного обеспечения инвестиционного менеджмента, формируемая из внешних и внутренних источников информации.</p>
4		<p>Тема 4: Содержание процесса стратегического управления инвестициями и формирование инвестиционной стратегии предприятия. Взаимосвязь инвестиционной политики и инвестиционной стратегии предприятия. Стадии разработки инвестиционной политики предприятия. Результаты финансовой диагностики - основа формирования инвестиционной стратегии предприятия. Объекты диагностики предприятия. Предмет диагностики. Цель и задачи диагностики принятия инвестиционных решений. Методики финансовой диагностики. Понятие инвестиционной стратегии и её роль в развитии предприятия. Главная цель инвестиционной стратегии предприятия. Основные этапы формирования инвестиционной стратегии предприятия. Разработка стратегических целей инвестиционной деятельности. Требования к формированию целей. Классификация стратегических целей инвестиционной деятельности</p>
5		<p>Тема 5: Стратегическое управление ресурсами предприятия в процессе инвестирования. Основные типы ресурсов на предприятии и возможности их использования. Невоспроизводимые и воспроизводимые ресурсы. Алгоритм ресурсного планирования проекта. Ресурсное планирование при ограничении по времени и планирование при ограниченных ресурсах. Формирование инвестиционных ресурсов необходимых для реального инвестирования. Сущность инвестиционных ресурсов предприятия. Разработка стратегии формирования инвестиционных ресурсов предприятия. Балансовый метод, метод аналогий и метод удельной капиталоемкости как основные методы расчёта потребности в инвестиционных ресурсах. Общая потребность в инвестиционных ресурсах для создания нового предприятия.</p>

6		<p>Тема 6: Анализ инвестиционных решений с использованием компьютерных технологий</p> <p>Принципы формирования и предварительной подготовки инвестиционных проектов. Этапы подготовки инвестиционной документации. Организация поиска инвестиционных возможностей. Предварительная подготовка проекта. Оценка технико-экономической и финансовой приемлемости проекта.</p> <p>Использование информационных технологий в инвестиционном проектировании. Пакет прикладных программ (ППП) ProjectExpert: задачи и содержание. Разделы программы ProjectExpert. ППП «Альт- Инвест»: задачи, содержание, структура программы.</p>
---	--	---

Таблица 5 – Матрица формирования компетенций по дисциплине

№ п/п	Темы дисциплины	ОПК-3
1	Основные категории инвестиционной деятельности	
2	Инвестиционный климат в России как макроэкономический фактор повышения инвестиционной активности	+
3	Теоретические и методические основы управления инвестированием	+
4	Содержание процесса стратегического управления инвестициями и формирование инвестиционной стратегии предприятия	+
5	Стратегическое управление ресурсами предприятия в процессе инвестирования	+
6	Анализ инвестиционных решений с использованием компьютерных технологий	+

6. Требования к написанию и оформлению контрольной работы

Работа студента над контрольным заданием состоит из трех этапов:

- 1) выбор темы контрольной работы;
- 2) изучение и анализ литературы по выбранной теме;
- 3) написание и оформление работы.

После того, как студент определился с темой контрольной работы, необходимо приступить к изучению и анализу литературы по выбранной теме. Список рекомендуемой литературы по дисциплине "Инвестиционная стратегия" приводится в конце настоящих методических указаний.

Изучив литературу по выбранной теме, студент приступает к написанию и оформлению контрольной работы. Контрольная работа по дисциплине "Инвестиционная стратегия" должна содержать:

1. Ответы на вопросы темы с приведением практических примеров;
2. Решение задач.

Окончательная стадия в работе над контрольной - ее оформление.

Обязательным условием является указание полностью фамилии, имени, отчества студента и шифра студента (номера зачетной книжки).

На 1-й странице работы необходимо грамотно и полностью указать название темы и ее порядковый номер. Не допускается произвольное сокращение или изменение названия темы.

После наименования темы пишется ее план. Количество вопросов в плане (в случае самостоятельной разработки плана) не должно быть меньше двух.

Материал в работе рекомендуется располагать в следующей последовательности:

- а) титульный лист (образец содержится в методических указаниях, указанных выше);
- б) содержание (пример оформления содержания контрольной работы содержится в приложении А);
- в) введение (описывается актуальность темы, цель, задачи и т.д.);
- г) первый раздел контрольной работы (теоретические аспекты);
- д) второй раздел контрольной работы (решение задач);
- е) заключение (основные выводы по работе);
- ж) список литературы.

Завершается оформление контрольной работы списком используемой литературы со всеми ее реквизитами. Список литературы должен быть оформлен в алфавитном порядке.

Список литературы указывается в соответствии с требованиями к оформлению библиографических списков (см. ГОСТ 7.1-2003. «Библиографическая запись. Библиографическое описание. Общие требования и правила составления»).

Рекомендуемый объем контрольной работы 20-25 страниц печатного текста.

Безусловными требованиями к контрольным работам по дисциплине "Инвестиционная стратегия" являются грамотность, аккуратность в оформлении, соответствие оформления текста контрольной работы ГОСТу.

Контрольные работы присылаются на проверку не позднее, чем за одну неделю до начала сессии. Не допускается сдача контрольных работ за день или в день зачета.

Таким образом, основная часть контрольной работы состоит из двух частей. В первой части описываются теоретические аспекты изучаемого вопроса. Во второй части контрольной работы - решение задач.

Варианты контрольной работы

Вариант 1.

1. Проблемы стратегической инвестиционной деятельности в современных условиях хозяйствования.
2. *Задача 1.1*

За пять лет величина денежного вклада возросла до 700 млн. рублей. За этот период (5 лет) начислены простые проценты в сумме 250 млн. руб. Найти величину процентной ставки.

Задача 1.2

Сколько лет необходимо для увеличения начальной суммы в 4 раза, если применяется сложная процентная ставка 12% годовых.

Задача 1.3

Какой из вариантов платежа более предпочтителен для получателя: получить через год 7 тыс. руб. или через 2 года 8 тыс. руб.? При этом издержки упущенных возможностей составляют 14% годовых.

Вариант 2.

1. Функции государства в регулировании инвестиционной деятельности.
2. *Задача 2.1*

На какой период должна быть выдана ссуда, чтобы долг возрос в 2,5 раза при начислении простых процентов по ставке 14% годовых.

Задача 2.2

За сколько лет первоначальная сумма увеличится в 4 раза, если в расчетах используется сложная ставка 18% годовых.

Задача 2.3

Платежи по 20 и 15 млн. руб. со сроком уплаты соответственно через 2 и 5 лет объединяются в один платеж через 4 года. Использовать сложную процентную ставку 15%. Рассчитать размер консолидированного платежа.

Вариант 3.

1. Общие принципы регулирования инвестиционного процесса в странах с развитой экономикой.
2. *Задача 3.1*

Сумма возврата долга (с процентами) составляет 15 тыс. руб. Деньги получены в долг под 14% годовых (простая ставка) на 160 дней. Найти первоначальную сумму долга (временная база – 360 дней).

Задача 3.2

Определить за какой период удвоится первоначальная сумма при значениях процентной ставки: а) 10%, б) 20%, в) 35%?

Задача 3.3

Являются ли полноценными два платежа: первый – уплатить 300 т.р. через два месяца; второй – уплатить 400 т.р. через 5 месяцев. При расчете использовать простую ставку 15% годовых.

Вариант 4.

1. Инвестиционная стратегия региона.
2. *Задача 4.1*

Вексель на сумму 600 т.р. учтен 10 марта. Срок погашения векселя 15 августа. Векселедержатель получил за него 480 т.р. Чему равна простая учетная ставка банка?

Задача 4.2

Вклад за 5 лет вырос до 900 т.р. За этот период начислены сложные проценты в сумме 250 т.р. Определить величину процентной ставки.

Задача 4.3

Потребитель обязан уплатить своему поставщику 8 т.р. через 3 месяца после поставки, 2 т.р. – через 4 месяца и 3 т.р. – через 6 месяцев. Стороны решили объединить платежи и выплатить единую сумму через 5 месяцев после поставки. Чему равна величина этого платежа при начислении простых процентов по ставке 15% годовых?

Вариант 5.

1. Инвестиционная политика РФ в современных условиях.
2. *Задача 5.1*

Начальная сумма долга – 200 млн. руб. В погашение долга должно быть выплачено 240 млн. руб. через 80 дней. Определить доходность данной операции для кредитора (временная база – 360 дней).

Задача 5.2

На депозит внесена сумма 400 т.р. Какая сумма будет на счете через 3 года, если используется сложная ставка 14% годовых?

Задача 5.3

Осуществить объединение двух платежей – 6 и 5 млн. руб. со сроками уплаты соответственно 120 и 130 дней – в один срок уплаты через 160 дней. Рассчитать размер консолидированного платежа при использовании в расчетах простой ставки 12% годовых (временная база 360 дней).

Вариант 6.

1. Стратегические цели инвестиционной деятельности.
2. *Задача 6.1*

Вклад размещен в банке на период с 10 июня по 15 сентября под 16% годовых. Рассчитать сумму дохода, которую получит вкладчик.

Задача 6.2

На депозит внесена сумма 400 т.р. Какая сумма будет на счете через 3 года, если в первый год используется сложная ставка 12% годовых, второй год – 14%, третий – 15%?

Задача 6.3

Платежи 100, 150 и 180 т.р. с выплатами через 30, 50, 70 дней соответственно заменяются одним платежом 450 т.р. Рассчитать срок консолидированного платежа, если в расчетах используется простая ставка 16% (временная база – 365 дней).

Вариант 7.

1. Основные методы регулирования инвестиционной деятельности в развитых странах.

2. Задача 7.1

За пять лет величина денежного вклада возросла до 600 т.р. За данный период начислены сложные проценты в сумме 200 т.р. Рассчитать величину процентной ставки.

Задача 7.2

Прогнозируемый среднемесячный темп инфляции 5%. Рассчитать годовой темп инфляции.

Задача 7.3

Необходимо объединить три платежа – 8, 5 и 10 т.р. – со сроками уплаты 1, 2 и 3 года в один платеж – 26 т.р. При расчете использовать сложную процентную ставку 10% годовых. Рассчитать срок консолидированного платежа.

Вариант 8.

1. Сущность и содержание инвестиционной стратегии.
2. *Задача 8.1*

На депозите размещены денежные средства в сумме 40 т.р. Первые три месяца начисляются простые проценты по ставке 24% годовых, далее наращенная сумма реинвестируется на следующие три месяца с начислением простых процентов по ставке 30%. Определить величину вклада на конец шестого месяца.

Задача 8.2

На первые два года кредитного периода установлена ставка сложных процентов 10%, на последующих три года – на уровне 14%. Рассчитать коэффициент (множитель) наращивания за весь период.

Задача 8.3

На депозит зачислено 300 т.р., на которые ежемесячно начисляются сложные проценты по ставке 14% годовых. Через 4 месяца сняты 50 т.р., а через 8 месяцев вклад был закрыт. Какая сумма была на счете в момент закрытия вклада (задача решается при помощи дисконтирования).

Вариант 9.

1. Принципы разработки инвестиционной стратегии.
2. *Задача 9.1*

Ссуда в 200 млн. руб. под 14% годовых получена 15 марта и должна быть возвращена 5 июля. Рассчитать совокупный долг (первоначальная ссуда с процентами).

Задача 9.2

Сложная процентная ставка равна 12%. Рассчитать коэффициент дисконтирования для пятого года.

Задача 9.3

Предприятие должно выплатить поставщику 100 т.р. через 3 месяца, еще 200 т.р. через 5 месяцев и 150 т.р. через последующие 2 месяца. Предприятие предлагает выплатить одним платежом в сумме 470 т.р. Рассчитать срок выплаты консолидированного платежа, если принята сложная ставка 14% годовых?

Вариант 10.

1. Инвестиционная стратегия РФ.
2. *Задача 10.1*

Рассчитать размер вклада и наращенную сумму через три года, если на депозите размещено 700 млн. руб. по простой ставке 12% годовых.

Задача 10.2

Банк предоставляет ссуду для получения реальных доходов в размере 8% годовых. Годовая инфляция – 10%. Рассчитать процентную ставку по кредиту.

Задача 10.3

Задолженность за поставленную продукцию по предприятию составляет 700 т.р. По договору оплата должна быть произведена 4-мя платежами через 3, 6, 9 и 10 месяцев. Предприятие предлагает погасить задолженность одним платежом через 7 месяцев. Рассчитать сумму единовременного платежа, если годовая процентная ставка составляет 12%.

Вариант 11.

1. Методы разработки инвестиционной стратегии.

2. Задача 11.1

Какой из вариантов платежа более предпочтителен для получателя: получить через год 4 тыс. руб. или через 2 года 5 тыс. руб.? При этом издержки упущенных возможностей составляют 15% годовых.

Задача 11.2

Определить простую учетную ставку эквивалентную годовой простой процентной ставке 20% при сроке 150 дней (временная база – 360 дней).

Задача 11.3

Три платежа – 4,5 и 10 млн. руб. со сроками уплаты через 1, 2 и 3 года объединяются в один платеж – 17 млн. руб. Найти срок консолидации платежа при сложной процентной ставке – 12% годовых.

Вариант 12.

1. Инвестиционная привлекательность отрасли
2. *Задача 12.1*

Платежи по 20 и 15 млн. руб. со сроком уплаты соответственно через 2 и 5 лет объединяются в один платеж через 4 года. Использовать сложную процентную ставку 15%. Рассчитать размер консолидированного платежа.

Задача 12.2

Первые два года начисляются сложные проценты по ставке 20%, вторые три года – 25%. Следующий год – 30%. Рассчитать среднегодовую процентную ставку.

Задача 12.3

Выплата долга в 40 млн. руб. осуществляется двумя суммами 1 апреля – 20 млн., 1 сентября – 20 млн. Порядок выплат изменен: 1 июня – 15 млн., а оставшуюся часть погасить 1 декабря. Найти оставшуюся часть долга при простой процентной ставке 15% и точное число дней ссуды. Принять за базовую дату приведения момент выплаты первых 20 млн. руб. Временная база 365 дней.

Вариант 13.

1. Этапы разработки инвестиционной стратегии.

2. Задача 13.1

Являются ли полноценными два платежа: первый – уплатить 300 т.р. через два месяца; второй – уплатить 400 т.р. через 5 месяцев. При расчете использовать простую ставку 15% годовых.

Задача 13.2

Непрерывное начисление процентов производится в течение 3-х лет под 14% годовых. Чему равна эквивалентная ставка сложных процентов?

Задача 13.3

Долг в 600 т.р. с оплатой через 4 года. Через 2 года выплатить 300 т.р., а оставшуюся сумму через 3 года. Использовать сложную ставку – 10%. Найти оставшуюся сумму.

Вариант 14.

1. Управление рисками при реализации инвестиционной стратегии.
2. Задача 14.1

Потребитель обязан уплатить своему поставщику 4 т.р. через 3 месяца после поставки, 2 т.р. – через 4 месяца и 3 т.р. – через 6 месяцев. Стороны решили объединить платежи и выплатить единую сумму через 5 месяцев после поставки. Чему равна величина этого платежа при начислении простых процентов по ставке 16% годовых?

Задача 14.2

Для первых трех лет ссуды применяется сложная ставка 12%, для следующих двух лет – 16%. Найти среднегодовую процентную ставку за весь период ссуды.

Задача 14.3

Выплату 400 т.р. 10 марта и 300 т.р. 25 августа заменить на 400 т.р. – 5 мая, а оставшуюся часть – 25 сентября. Определить величину оставшейся выплаты при простой ставке 40% годовых. Все выплаты привести к дате последнего платежа.

Вариант 15.

1. Инфляция и ее учет при принятии стратегических инвестиционных решений.
2. Задача 15.1

Осуществить объединение двух платежей – 8 и 5 млн. руб. со сроками уплаты соответственно 110 и 130 дней – в один срок уплаты через 150 дней. Рассчитать размер консолидированного платежа при использовании в расчетах простой ставки 12% годовых (временная база – 360 дней).

Задача 15.2

Вексель учитывается по простой учетной ставке 14% за 90 дней до погашения. Предполагается перейти к сложной учетной ставке. Какую сложную ставку надо установить, чтобы финансовое положение банка не изменилось?

Задача 15.3

Долг в 8 т. р. выплачивается в два этапа: сегодня – ? и 3 т.р. через 2 года. Предлагается вернуть 30% совокупной выплаты через 1 год, а оставшуюся часть – через следующие 2 года. Какими должны быть новые платежи, чтобы финансовые взаимоотношения сторон не изменились при использовании в расчетах сложной ставки – 30% годовых.

Вариант 16.

1. Стратегическое инвестиционное решение и влияющие на него факторы.

2. Задача 16.1

Платежи 200, 150 и 180 т.р. с выплатами через 30, 50, 70 дней соответственно заменяются одним платежом 550 т.р. Рассчитать срок консолидированного платежа, если в расчетах используется простая ставка 14% (временная база – 365 дней).

Задача 16.2

Денежные средства в равных размерах размещены на трех депозитах по ставке простых процентов 12, 15 и 18% соответственно на 3, 6 и 9 месяцев. Какой размер ставки приведет к аналогичному наращиванию исходной суммы, если ее разместить на одном депозите на 16 месяцев?

Задача 16.3

Предприниматель должен выплатить: 200 т.р. через 3 мес., 200 т.р. через 5 мес. и 150 т.р. через последующие 2 мес. Предлагается сделать выплату одним платежом в сумме 570 т.р. Определить срок выплаты при сложной ставке 15% годовых.

Вариант 17.

1. Взаимосвязь инвестиционной стратегии с другими стратегиями организациями.
2. *Задача 17.1*

Необходимо объединить три платежа – 4, 5 и 10 т.р. – со сроками уплаты 1, 2 и 3 года в один платеж – 17 т.р. При расчете использовать сложную процентную ставку 12% годовых. Рассчитать срок консолидированного платежа.

Задача 17.2

Рассчитать годовую ставку простых процентов, на которую можно заменить номинальную годовую ставку 14%, если начисление по ней производится по полугодиям в течение 3 лет.

Задача 17.3

Предприятие обязано выплатить поставщику: 5 млн. через 3 мес. после поставки, 2 млн. – через 4 мес. и 3 млн. – через 6 мес. Предложено платежи объединить и выплатить через 5 мес. после поставки. Определить величину платежа при простой ставке 16%.

Вариант 18.

1. Личная инвестиционная стратегия.
2. *Задача 18.1*

На депозит зачислено 650 т.р., на которые ежемесячно начисляются сложные проценты по ставке 14% годовых. Через 4 месяца сняты 250 т.р., а через 6 месяцев вклад был закрыт. Какая сумма была на счете в момент закрытия вклада.

Задача 18.2

Рассчитать годовую ставку простых процентов, на которую можно заменить номинальную годовую ставку 12%, если начисление по ней производится по полугодиям в течение 2 лет.

Задача 18.3

В банк положены 200 т.р. при ежемесячном начислении сложных процентов – 14% годовых. Через 4 мес. сняты 50 т.р., а через 8 мес. вклад был закрыт. Определить сумму вклада на момент его закрытия (использовать метод дисконтирования).

Вариант 19.

1. Оценка эффективности инвестиционной стратегии.
2. *Задача 19.1*

Предприятие должно выплатить поставщику 150 т.р. через 3 месяца, еще 250 т.р. – через 5 месяцев и 150 т.р. – через последующие 2 месяца. Предприятие предлагает выплатить одним платежом в сумме 570 т.р. Рассчитать срок выплаты консолидированного платежа, если принята сложная ставка 15% годовых?

Задача 19.2

Вексель учитывается по простой учетной ставке 14% за 100 дней до погашения. Предполагается перейти к сложной учетной ставке. Рассчитать сложную учетную ставку, чтобы финансовое положение банка не изменилось.

Задача 19.3

Какую денежную сумму можно положить в банк, чтобы в течение последующих пяти лет снимать со счета 700 руб. ежегодно и полностью исчерпать сумму к концу этого срока? Сложные проценты начисляются по непрерывной ставке 30%.

Вариант 20.

1. Выбор (оптимизация) инвестиционной стратегии.
2. *Задача 20.1*

Задолженность за поставленную продукцию по предприятию составляет 600 т.р. По договору оплата должна быть произведена 4-мя платежами через 3, 6, 9 и 10 месяцев. Предприятие предлагает погасить задолженность одним платежом через 6 месяцев. Рассчитать сумму единовременного платежа, если годовая процентная ставка составляет 12%.

Задача 20.2

Ссуда выдана на 2 года под простые проценты по ставке 13% годовых. Рассчитать эквивалентную ставку сложных процентов.

Задача 20.3

Непрерывное начисление процентов производится в течение 3-х лет под 15% годовых. Чему равна эквивалентная ставка сложных процентов?

7. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

а) основная литература:

1. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] : / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2014. — 544 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=56365

2. Нешиной, А.С. Инвестиции [Электронный ресурс] : учебник. — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2014. — 352 с. — Режим доступа:

http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=56202

3. Николаева, И.П. Инвестиции: Учебник для бакалавров [Электронный ресурс] : учебник. — Электрон. дан. — М. : Дашков и К, 2013. — 254 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=5666

4. Орлова, Е.Р. Инвестиции. Учебное пособие [Электронный ресурс] : учебное пособие. — Электрон. дан. — М. : Омега-Л, 2012. — 240 с. — Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=5529

5. Кузнецов, Б.Т. Инвестиции: учебное пособие; рекомендовано УМЦ/ Б. Т. Кузнецов. - 2-е изд., перераб. и доп.. - М.: Юнити-Дана, 2010. - 623 с..

6. Басовский, Л.Е. Экономическая оценка инвестиций: учеб. пособие; допущено УМО по образованию в области производственного менеджмента / Л. Е. Басовский, Е. Н. Басовская.-М.: Инфра-М, 2008.-241 с.

7. Янковский, К.П. Инвестиции: учебное пособие; рекомендовано УМО по образованию в области ФУ и МЭ/ К. П. Янковский. - СПб.: Питер, 2008. - 368 с..

б) дополнительная литература:

8. Инвестиции: системный анализ и управление: учебное пособие/ ред. К. В. Балдин. - 4-е изд., испр.. - М.: Издательско - торговая корпорация "Дашков и К", 2010. - 288 с.

9. Чернов, В.А. Инвестиционный анализ: учебное пособие/ В. А. Чернов ; ред. М. И. Баканов. - 2-е изд., перераб. и доп

10. Чиненов, М.Р. Инвестиции: учебное пособие; рекомендовано УМО по образованию в области ФУ и МЭ/ М. В. Чиненов ; ред. М. В. Чиченов. - 3-е изд., стер.. - М.: Кнорус, 2010. - 368 с.

11. Колмыкова, Т.С. Инвестиционный анализ: учебное пособие; рекомендовано УМО по образованию в области ФУ и МЭ/ Т. С. Колмыкова. - М.: Инфра-М, 2009. - 204 с

12. Ендовицкий Д. А. Инвестиционный анализ в реальном секторе экономики: учеб. пособие; рекомендовано УМО вузов ФА / Под ред. Л. М. Гиляровской. – М: Финансы и статистика, 2003. – 352 с.

13. Ендовицкий Д. А. Практикум по инвестиционному анализу: учеб. пособие. – М: Финансы и статистика, 2003. – 240 с