ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ ПО ДИСЦИПЛИНЕ  
«ИНВЕСТИЦИОННЫЙ АНАЛИЗ»

1. Охарактеризовать основные положения инвестиционного процесса.

1. Привести классификацию инвестиций.

3. Раскрыть содержание следующих понятий: инвестиционная привлекательность; инвестиционный потенциал; инвестиционные риски.

1. Охарактеризовать факторы, воздействующие на инвестиционный климат.
2. Раскрыть особенности государственного регулирования инвестирования в реальные активы.
3. Раскрыть особенности государственного регулирования инвестирования в ценные бумаги.
4. Охарактеризовать следующую составляющую требуемой доходности инвестиций: воздействие временного фактора.
5. . Охарактеризовать следующую составляющую требуемой доходности инвестиций: оценка фактора инфляции.
6. Охарактеризовать следующую составляющую требуемой доходности инвестиций: оценка фактора риска.
7. Привести и раскрыть содержание показателей оценки риска инвестиций.
8. Привести и раскрыть содержание простого и сложного процента.
9. Раскрыть содержание понятия «капитальные вложения». Охарактеризовать объекты и субъекты капитальных вложений.
10. Раскрыть сущность инвестиционного проекта. Привести классификацию инвестиционных проектов.
11. Охарактеризовать инвестиционные проекты по степени взаимного влияния друг на друга, и по сроку реализации.
12. Охарактеризовать инвестиционные проекты по масштабу и по основной направленности.
13. Раскрыть сущность инвестиционного цикла и охарактеризовать его четыре фазы.
14. Привести классификация источников финансирования инвестиционных проектов.
15. Охарактеризовать основные формы финансирования инвестиционных проектов,
16. Охарактеризовать, что подразумевают под эффективностью инвестиционных проектов. Привести и охарактеризовать два вида эффективности инвестиционных проектов.
17. Охарактеризовать общую схему оценки эффективности инвестиционных проектов.
18. Охарактеризовать, что подразумевают под эффективностью инвестиционных проек­тов. Привести два метода оценки эффективности оценки инвестиционных проектов.
19. Охарактеризовать чистую приведенную стоимость (NPV) как инструмент оценки эффективности инвестиционного проекта.
20. Описать правила, которыми следует руководствоваться при определении приведенной стоимости и проведении операции дисконтирования.
21. Привести и кратко охарактеризовать содержание денежных потоков.
22. Охарактеризовать денежный поток от инвестиционной деятельности.
23. Охарактеризовать денежный поток от операционной деятельности.
24. Охарактеризовать денежный поток от финансовой деятельности.
25. Охарактеризовать денежный поток от операционной деятельности.
26. Кратко охарактеризовать чистую приведенную стоимость (NPV) как инструмент оценки эффективности инвестиционного проекта. Описать его недостатки.
27. Охарактеризовать срок окупаемости как метод оценки эффективности инвестиционного проекта. Описать его преимущества и недостатки.
28. Охарактеризовать внутреннюю норму доходности (отдачи) (IRR) как метод оценки эффективности инвестиционного проекта. Описать его преимущества и недостатки.
29. Охарактеризовать индекс рентабельности как метод оценки эффективности инвестиционного проекта.
30. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод качественной оценки рисков: экспертный метод.
31. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод качественной оценки рисков: метод Дельфи.
32. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод качественной оценки рисков: метод анализа уместности затрат.
33. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарак­теризовать следующий метод качественной оценки рисков: метод аналогий.
34. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод количественной оценки рисков: анализ чувствительности проекта.
35. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарак­теризовать следующий метод количественной оценки рисков: анализ сценариев.
36. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод количественной оценки рисков: имитационное моделирование методом Монте-Карло.
37. Привести классификацию методов оценки рисков инвестиционного проекта. Охарактеризовать следующий метод количественной оценки рисков: анализ предельного уровня устойчивости.
38. Привести основные меры по снижению инвестиционного риска.

42. Привести ключевые допущения модели Г. Марковица.

1. Охарактеризовать границу эффективных портфелей согласно модели Г. Марковица.
2. Раскрыть суть теоремы Г. Марковица.
3. Раскрыть суть модели У. Шарпа.
4. Привести уравнение линейной регрессии согласно модели У. Шарпа. Охарактеризо вать параметр «альфа».
5. Привести уравнение линейной регрессии согласно модели У. Шарпа. Охарактеризовать параметр «бета».
6. Охарактеризовать основные положения модели ценообразования финансового средства (САРМ).
7. Охарактеризовать основные допущения модели САРМ.

50. Привести формулу модели САРМ и охарактеризовать ее составляющие.

1. Привести и кратко охарактеризовать три составляющие получения дохода (отдачи) от владения облигацией.
2. Охарактеризовать первую составляющую получения дохода (отдачи) от владения облигацией - цена отчуждения облигации.
3. Охарактеризовать вторую составляющую получения дохода (отдачи) от владения об­лигацией - сумма купонных выплат.
4. Охарактеризовать третью составляющую получения дохода (отдачи) от владения об­лигацией - процент на процент.
5. Охарактеризовать следующий вид доходности облигации: номинальная, или купон­ная, доходность; текущая доходность.
6. Охарактеризовать следующий вид доходности облигации: доходность к погашению (YTМ).
7. Привести факторы, определяющие доходность облигации. Охарактеризовать риск банкротства эмитента (кредитный риск).
8. Раскрыть сущность и свойства волатильности цены облигации.
9. Раскрыть сущность и свойства дюрации облигаций.
10. Привести и кратко охарактеризовать три основные стратегические цели формирования портфеля облигаций.
11. . Охарактеризовать следующую стратегическую цель формирования портфеля облигаций: получение стабильного дохода.
12. Охарактеризовать следующую стратегическую цель формирования портфеля облигаций: аккумулирование требуемой суммы денег .
13. Охарактеризовать следующую стратегическую цель формирования портфеля облигаций: увеличение суммарной отдачи.
14. Охарактеризовать взвешенную но времени доходность TWR.
15. Охарактеризовать взвешенную по деньгам доходность MWR.
16. Привести и. охарактеризовать следующий показатель оценки результатов инвестици­онной деятельности с учетом соотношения доходности и риска: мера Трейнора.
17. Привести и охарактеризовать следующий показатель оценки результатов инвестици­онной деятельности с учетом соотношения доходности и риска: мера Дженсена.
18. Привести и охарактеризовать следующий показатель оценки результатов инвестиционной деятельности с учетом соотношения доходности и риска: мера Шарпа.
19. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инструмент: антикварная мебель.
20. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: антикварные произведения живописи.
21. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: антикварные книги.
22. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: старинные монеты.
23. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: коллекционные вина.
24. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: драгоценные камни.
25. Охарактеризовать особенности инвестирования в следующий нефинансовый инстру­мент: раритетные автомобили.