

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Игнатенко Виталий Иванович

Должность: Проректор по образовательной деятельности и молодежной политике

Дата подписания: 08.04.2025 18:00:39

Уникальный программный ключ:

a49ae343af5448d45d7e3e1e499659da8109ba78

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Заполярный государственный университет им. Н. М. Федоровского»

Кафедра «Экономика, менеджмент и организация производства»

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
по дисциплине
Экономическая оценка инвестиций

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Профиль: Финансы и кредит

Уровень образования: бакалавриат

Разработчик ФОС:

К.э.н., доцент

Ю.Ю. Доменко

Оценочные материалы по дисциплине рассмотрены и одобрены на заседании
кафедры, протокол № №8 от 07.03.2024 г.

Заведующий кафедрой _____ к.э.н., доцент Н.А. Торгашова

Фонд оценочных средств по дисциплине Экономическая оценка инвестиций для текущей/ промежуточной аттестации разработан в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по специальности / направлению подготовки 38.03.01 Экономика на основе Рабочей программы дисциплины Экономическая оценка инвестиций, утвержденной решением ученого совета от 07.03.2024 г., Положения о формировании Фонда оценочных средств по дисциплине (ФОС), Положения о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся ЗГУ, Положения о государственной итоговой аттестации (ГИА) выпускников по образовательным программам высшего образования в ЗГУ им. Н.М. Федоровского.

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами образовательной программы

Таблица 1. Компетенции и индикаторы их достижения

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения
УК-10 Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	УК-10.5 Способен осуществлять оценку инвестиций для принятия взвешенных и обоснованных экономических решений
ПК-3 Способен организовывать эффективную деятельность финансовых и кредитных организаций	ПК-3.3 Способен проводить экономическую оценку инвестиций для эффективной деятельности финансовых и кредитных организаций

Таблица 2. Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код результата обучения по дисциплине/ модулю	Оценочные средства текущей аттестации		Оценочные средства промежуточной аттестации	
			Наименование	Форма	Наименование	Форма
5 семестр						
6 семестр						

2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие процесс формирования компетенций в ходе освоения образовательной программы.

2.1. Задания для текущего контроля успеваемости

1. Инвестиции, экономическая сущность и виды.
2. Инвестиции, осуществляемые в форме капитальных вложений.
3. Состав и структура капитальных вложений. Объекты капитальных вложений.
4. Инвестиционная деятельность. Правовые основы ее осуществления.
Субъекты инвестиционной деятельности, осуществляемой в форме капитальных вложений.
5. Государственное регулирование условий инвестиционной деятельности.
6. Инвестиционный проект: понятие, классификация.
7. Фазы (стадии) развития инвестиционного проекта. Их характеристика.
8. Общие принципы оценки эффективности инвестиционных проектов.

9. Простые методы оценки эффективности проекта.
10. Сложные методы оценки инвестиционных проектов.
11. Денежные потоки как необходимый элемент инвестиционного анализа. Классификация денежных потоков по видам деятельности.
12. Бюджетная эффективность реализации проекта. Эффективность проекта в целом и эффективность участия в проекте.
13. Оценка рисков, количественные и качественные методы оценки риска и неопределенности.
14. Понятие инвестиционного портфеля. Цели формирования инвестиционного портфеля. Типы инвестиционных портфелей.
15. Принципы формирования портфеля инвестиций. Этапы формирования и управления инвестиционным портфелем. Факторы, учитываемые при формировании инвестиционного портфеля.
16. Определение дохода и риска по портфелю инвестиций. Диверсификация портфеля. Стратегии управления портфелем инвестиций.
17. Источники финансирования капитальных вложений.
18. Бюджетное финансирование. Возвратный и безвозвратный характер финансирования.
19. Собственные средства инвесторов. Состав и структура собственных источников средств.
20. Заемные денежные средства как один из источников финансирования инвестиций.
21. Средства иностранных инвесторов, ассигнования и привлеченные денежные средства как источник финансирования инвестиционных проектов.
22. Лизинг. Общая характеристика, преимущества такого метода финансирования капитальных вложений. Виды лизинга.
23. Инвестиционные качества ценных бумаг.
24. Оценка эффективности инвестиций в ценные бумаги.
25. Оценка облигаций и акций.

2.2. Задания для промежуточной аттестации

2.2.1. Контрольные вопросы к экзамену(зачету)

Экономическая оценка инвестиций

Что такое чистая приведенная стоимость (NPV)?

- а) Сумма всех будущих денежных потоков
- б) Разница между приведенной стоимостью доходов и затратами +
- с) Сумма всех затрат на проект

Какой метод оценки инвестиций учитывает временную стоимость денег?

- а) Метод простого расчета
- б) Метод дисконтирования +
- с) Метод сравнения

Что такое внутренняя норма доходности (IRR)?

- а) Ставка, при которой NPV равна нулю +
- б) Максимальная ставка дисконтирования
- в) Средняя ставка доходности

Какой из следующих факторов не влияет на оценку инвестиционного проекта?

- а) Риск проекта
- б) Сроки реализации
- в) Личное мнение инвестора +

Что такое срок окупаемости?

- а) Время, необходимое для возврата первоначальных инвестиций +
- б) Время, необходимое для достижения максимальной прибыли
- в) Время, необходимое для завершения проекта

Какой из методов оценки инвестиций является наиболее простым?

- а) Метод дисконтирования
- б) Метод простого расчета +
- в) Метод сравнительного анализа

Что такое чувствительность анализа?

- а) Оценка влияния изменений в предположениях на результаты +
- б) Оценка рисков проекта
- в) Оценка финансовых показателей

Какой из следующих показателей используется для оценки ликвидности проекта?

- а) NPV
- б) IRR
- в) Коэффициент текущей ликвидности +

Что такое дисконтирование?

- а) Процесс увеличения будущих денежных потоков
- б) Процесс уменьшения будущих денежных потоков до их текущей стоимости +

- с) Процесс оценки рисков

Какой из следующих факторов не учитывается при расчете NPV?

- а) Будущие денежные потоки

- б) Ставка дисконтирования

- с) Налоги на прибыль +

Что такое риск в инвестициях?

- а) Вероятность получения прибыли

- б) Вероятность потерь или недостижения ожидаемых результатов +

- с) Вероятность успешного завершения проекта

Какой из методов оценки инвестиций учитывает альтернативные затраты?

- а) Метод дисконтирования

- б) Метод сравнительного анализа

- с) Метод экономической добавленной стоимости (EVA) +

Что такое экономическая добавленная стоимость (EVA)?

- а) Разница между доходами и затратами

- б) Прибыль после вычета всех затрат и нормированной прибыли +

- с) Чистая прибыль компании

Какой из следующих показателей показывает, насколько эффективно используются активы?

- а) ROI (возврат на инвестиции) +

- б) NPV

- с) IRR

Что такое анализ сценариев?

- а) Оценка одного сценария

- б) Оценка нескольких возможных сценариев +

- с) Оценка только негативных сценариев

Какой из следующих методов оценки инвестиций является наиболее сложным?

- a) Метод простого расчета
- b) Метод дисконтирования +
- c) Метод сравнительного анализа

Что такое маржинальная стоимость?

- a) Стоимость, которая не изменяется при изменении объема производства
- b) Дополнительные затраты на производство одной дополнительной единицы продукции +
- c) Общие затраты на производство

Какой из следующих факторов влияет на ставку дисконтирования?

- a) Уровень инфляции +
- b) Сроки проекта
- c) Личное мнение инвестора

Что такое финансовый рычаг?

- a) Использование заемных средств для увеличения доходности +
- b) Использование собственных средств
- c) Использование активов компании

Какой из следующих показателей используется для оценки прибыльности проекта?

- a) NPV
- b) IRR +
- c) Срок окупаемости

2.2.2. Типовые экзаменационные задачи

2.2.3. Темы/задания курсовых проектов/курсовых работ

Темы для рефератов

- Чистая приведенная стоимость (NPV) как основной критерий оценки инвестиционных проектов.
- Внутренняя норма доходности (IRR): методы расчета и применение.
- Сравнительный анализ методов оценки инвестиций: преимущества и недостатки.
- Влияние временной стоимости денег на инвестиционные решения.

- Анализ чувствительности в оценке инвестиционных проектов.
- Риск и неопределенность в инвестиционных оценках: методы управления.
- Экономическая добавленная стоимость (EVA) как инструмент оценки эффективности.
- Методы дисконтирования: теоретические основы и практическое применение.
- Срок окупаемости: его значение и ограничения в инвестиционном анализе.
- Альтернативные затраты: концепция и влияние на инвестиционные решения.
- Финансовый рычаг: как заемные средства влияют на доходность инвестиций.
- Анализ сценариев в оценке инвестиционных проектов: подходы и примеры.
- Методы оценки ликвидности инвестиционных проектов.
- Роль налогов в оценке инвестиционных проектов: влияние на NPV и IRR.
- Инвестиционные риски: классификация и методы оценки.
- Сравнительный анализ методов оценки проектов в условиях неопределенности.
- Влияние инфляции на ставку дисконтирования и оценку инвестиций.
- Методы оценки социальных и экологических последствий инвестиционных проектов.
- Кейс-стадии успешных и неудачных инвестиционных проектов: уроки для инвесторов.
- Использование финансовых моделей для оценки инвестиционных проектов.
- Психология инвестирования: как личные убеждения влияют на инвестиционные решения.
- Оценка инвестиционных проектов в условиях международной экономики.
- Роль корпоративного управления в оценке и реализации инвестиционных проектов.
- Технологические инновации и их влияние на инвестиционные решения.
- Будущее оценки инвестиций: новые подходы и технологии.