

Перечень контрольных вопросов и заданий для самостоятельной работы студентов

1. Инвестиции и их народнохозяйственное значение.
2. Классификация и структура инвестиций.
3. Источники финансирования инвестиций.
4. Понятие инвестиционной деятельности.
5. Инвестиционная политика, ее сущность и роль в современных условиях.
6. Стратегический подход к реализации инвестиционной деятельности.
7. Инвестиционный рынок: общие положения, структура. Участники инвестиционного рынка.
8. Понятие об инвестиционных проектах и их классификация.
9. Содержание инвестиционного проекта.
10. Жизненный цикл инвестиционного проекта, его структура.
11. Виды и последовательность проведения работ при организации инвестиционного проектирования.
12. Проведение исследования возможностей.
13. Разработка концепции проекта.
14. Техничко-экономические исследования по проекту.
15. Финансовая модель инвестиционного решения и ее структура.
16. Категории инвестиционных активов и модели их оценки.
17. Сущность и принципы определения экономической эффективности инвестиционных проектов.
18. Денежные потоки инвестиционного проекта.
19. Релевантность денежных потоков от активов.
20. Анализ проектов, не имеющих отдельного коммерческого результата.
21. Сущность и измерители инфляции.
22. Номинальные и реальные процентные ставки.
23. Учет инфляции при инвестиционном анализе.
24. Этапы обоснования инвестиционного решения.
25. Классификация методов оценки инвестиционного проекта.
26. Статические методы оценки инвестиций.
27. Методы оценки инвестиций, основанные на дисконтировании денежных потоков (динамические).
28. Сравнительная эффективность проектов с различными сроками службы основных средств.
29. Сравнение экономической эффективности проектов с разными сроками жизни и масштабами.
30. Оценка влияния реализации инвестиционного проекта на показатели эффективности действующего предприятия.
31. Понятие о доходности инвестиций.
32. Требуемый уровень доходности инвестиционного проекта.
33. Определение ставки дисконта.
34. Методы оценки стоимости собственного капитала

35. Доходность и риск инвестирования.
36. Безрисковая доходность.
37. Классификация рисков.
38. Кредитный рейтинг страны как мера странового риска.
39. Рыночные индексы.
40. Систематический и несистематический риск инвестирования.
41. Портфельный риск инвестора. Линии рынка капитала и фондового рынка.
42. Принцип применения CAPM на развитом рынке капитала.
43. Методы определения коэффициентов β .
44. Трудности применения классической модели CAPM в условиях развивающихся рынков.
45. Получение параметров модели CAPM для развивающегося рынка путем корректировки данных глобального рынка
46. Определение стоимости заемного капитала.
47. Структура капитала инвестиционного проекта и ее обоснование.
48. Влияние структуры и стоимости капитала на эффект инвестиционного проекта и ценность предприятия.
49. Неопределенность, риск и устойчивость инвестиционного проекта.
50. Факторы риска внешней и внутренней среды.
51. Степень устойчивости проекта.
52. Понятие чувствительности проекта.
53. Требования к базовому сценарию.
54. Методы анализа чувствительности: метод опорных точек и метод рациональных диапазонов.
55. Сущность, цели и этапы сценарного анализа.
56. Варианты информационной достаточности (наличие или отсутствие вероятностей отдельных сценариев).
57. Критерии ранжирования по риску сценарным методом.
58. Дерево решений и дерево вероятностей. Алгоритм принятия решения в рамках метода дерева вероятностей.
59. Метод Хайлера.
60. Метод Монте-Карло, как метод имитационного моделирования.
61. Факторы имитационной модели.
62. Алгоритм имитационного моделирования.
63. Оценка устойчивости инвестиционного проекта с использованием метода нечетких множеств (Fuzzy logic).
64. Недостатки методологии анализа дисконтированных денежных потоков.
65. Виды реальных опционов.
66. Реальные опционы как фактор создания дополнительной стоимости.
67. Ограничения и недостатки анализа реальных опционов.
68. Биномиальный метод оценки реальных опционов.
69. Модель Блека-Шоулза для определения стоимости реальных опционов.

70. Интегрированная модель дисконтированных денежных потоков и реальных опционов.
71. Понятие, назначение и цели бизнес-планирования на предприятии.
72. Классификация бизнес-планов.
73. Правовая основа составления бизнес-планов в Республике Беларусь.
74. Структура и содержание разделов бизнес-плана.
75. Методы и формы финансирования инвестиций.
76. Самофинансирование.
77. Бюджетное финансирование инвестиций.
78. Акционерное финансирование.
79. Банковское кредитование инвестиционной деятельности.
80. Консорциальное и синдицированное кредитование инвестиционных проектов.
81. Проектное финансирование инвестиционной деятельности.
82. Методические подходы к формированию бюджета капиталовложений.
83. Формирование инвестиционной программы предприятия.
84. Рациональное распределение капитала между проектами.
85. Понятие инвестиционного портфеля.
86. Стратегия управления инвестиционным портфелем.
87. Согласование интересов участников инвестиционного проекта.
88. Проектно-сметная документация инвестиционного проекта
89. Принципы и этапы проектирования.
90. Организационные формы и задачи проектных организаций.
91. Содержание, порядок разработки и утверждения проектов.
92. Сметная документация
93. Формы государственного регулирования инвестиционной деятельности.
94. Правовое обеспечение инвестиционной деятельности в Республике Беларусь.
95. Инвестиционная политика Беларуси.
96. Механизмы реализации инвестиционной политики для национальных инвестиций.
97. Формы привлечения и государственного регулирования иностранных инвестиций.
98. Особенности осуществления инвестиционной деятельности на основе концессий.
99. Понятие инвестиционного климата и его оценка.