

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»
(ТвГТУ)

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий кафедрой ЭУП

(подпись)

д.э.н., доцент И.В. Вякина
« ____ » _____ 2022 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

экзамена

(промежуточной аттестации: экзамен, зачет, курсовая работа или курсовой проект; практики: с указанием вида и типа практики; государственного экзамена)

Анализ эффективности инвестиционной деятельности

Наименование дисциплины (для промежуточной аттестации)

Специалитет __38.05.01 Экономическая безопасность_____
Направленность (профиль) – Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности
Типы задач профессиональной деятельности: информационно-
аналитический, организационно-управленческий, научно-
исследовательский

Разработаны в соответствии с:
рабочей программой дисциплины,
утвержденной 05.07.2022 г.

Разработчик: Александров Г.А.

Тверь 2022

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Оценка эффективности управления портфельными инвестициями.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните логику технико – экономического анализа ЮНИДО.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Продемонстрируйте на условном примере применение метода NPV для оценки инвестиционных проектов.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 2

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Пересмотр (реструктурирование) инвестиционного портфеля.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Обоснуйте принцип выбор оптимального инвестиционного портфеля.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Проиллюстрируйте применение метода «период окупаемости (PP)» для оценки эффективности инвестиционного решения на условном примере.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 3

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Использование результатов матричного анализа для формирования
Инвестиционно – привлекательного климата.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Общее и особенное в оценке и ранжировании инвестиционных проектов
методом NPV и IRR. Продемонстрируйте это на графике.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Инвестиции по проекту 200 000 рублей. Годовой доход в 40000 рублей.
Горизонт планирования 10 лет. Насколько целесообразны инвестиции, если
коэффициент дисконтирования – 20%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 4

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Выбор оптимального портфеля и его диверсификация.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Чем объясняется выбор кумулятивного метода оценки рисков инвестирования?
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Выполните на условном примере сравнительный анализ проектов различной продолжительности с использованием метода IRR.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 5

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Использование матричного метода для оценки несистематической составляющей инвестиционного риска.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Обоснуйте подход к выбору наиболее привлекательного для Вас инвестиционного портфеля из ряда возможных.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Проект, рассчитан на 15 лет и требует инвестиций в размере 150000 рублей. В первые 5 лет поступлений не ожидается. В последующие 10 лет ежегодный доход составит 50000 рублей. Принимать ли этот проект, если коэффициент дисконтирования равен 15%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вязина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 6

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Типы воспроизводства. НТП и интенсификация производства.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Объясните, какими факторами и почему Вы руководствуетесь при выборе нормы дисконта для расчёта NPV инвестиционных проектов.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Каков срок окупаемости инвестиций, если они составляют 280 тысяч рублей, а годовая величина чистого денежного потока ожидается в размере 50 тысяч рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 7

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Вычисление ожидаемой доходности инвестиционного портфеля.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Обоснуйте целесообразность использования ускоренной амортизации для увеличения собственных средств, как одного из источников инвестирования.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Инвестиции по проекту 150 000 рублей. Годовой доход в 30000 рублей. Горизонт планирования 10 лет. Насколько целесообразны инвестиции, если коэффициент дисконтирования – 15%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственной технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 8

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 2 балла или 2 балла:
Формирование инвестиционного портфеля: подход Гарри Марковица.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните своё решение о выборе конкретного метода оценки эффективности инвестиционного проекта.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Окупаем ли проект, если коммерческая организация берёт инвестиционный кредит на трехлетний период в размере 400 тыс. рублей, планируя ежегодно получать чистый денежный поток от реализации проекта в размере 150 тыс. рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 9

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Анализ рынка ценных бумаг. Ожидаемая доходность ценных бумаг и стандартное отклонение.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла
Обоснуйте решение о выборе в качестве инвестора венчурный фонд.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
На счете в банке 1,0 миллион рублей. Банк платит 9,0% годовых.
Целесообразно ли входить этим капиталом в бизнес, если прогнозируется удвоение капитала через 4 года.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 10

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 2 балла:

Выбор инвестиционной политики. Определение толерантности риска.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Обоснуйте целесообразность сотрудничества с НПФ, имея в виду возможность финансирования инвестиций.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Инвестиции по проекту 180 000 рублей. Годовой доход в 20000 рублей. Горизонт планирования 10 лет. Насколько целесообразны инвестиции, если коэффициент дисконтирования – 20%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 11

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Сущность инвестиций и факторы их определяющие.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

При решении начать своё дело предприниматель использует разные источники и схемы инвестирования. Объясните какая из двух схем инвестирования предпочтительнее, с учётом того, что Вы только начинаете своё дело?

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Какова текущая цена бессрочной облигации, если выплачиваемый по ней годовой доход составляет 100 тысяч рублей, а рыночная доходность – 12%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 12

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Инвестиционный климат и инвестиционные риски: характер взаимосвязи.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Обоснуйте решение о выборе привлекательно для Вас портфеля из эффективного множества портфелей.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Имеет ли смысл инвестору приобрести дополнительно акции или, наоборот, продать имеющиеся, если ежегодные дивиденды, выплачиваемые по ним, составляют 120 тыс. руб., текущая рыночная стоимость каждой акции составляет 500 тыс. руб., а рыночная ставка дохода оценивается в 20% годовых.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 13

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:
Основные источники и формы инвестиций.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Обоснуйте целесообразность пересмотра инвестиционного портфеля.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Собрание акционеров приняло решение ограничить в предстоящие два года выплату дивидендов на акцию общей суммой в 800 руб. В последующие четыре года оно обязалось выплачивать ежегодные дивиденды на акцию в размере 250 руб. Норма ожидаемой доходности акции данного типа составляет 20% в год. Определите текущую рыночную стоимость акции.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ №_14_

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Оценка инвестиций по внутренней норме доходности (IRR).

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните своё решение о выборе конкретного подхода к оценке ценных бумаг.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Целесообразна ли реализация инвестиционного проекта, если фирма получает инвестиционный кредит в размере 420 тыс.рублей на четырёхлетний период и планирует ежегодно получать чистый денежный поток от реализации проекта в размере 110 тыс.рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 15

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:
Сущность и фазы инвестиционного проекта.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Аргументируйте выбор варианта инвестирования временно свободных денежных средств, принимая во внимание уровень Вашей толерантности к риску.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Каков срок окупаемости инвестиций, если они составляют 350 тысяч рублей, а годовая величина чистого денежного потока ожидается в размере 200 тысяч рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 16

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:
Предынвестиционная фаза инвестиционного проекта и ее стадии.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Обоснуйте решение о необходимости реструктуризации инвестиционного портфеля.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Какова текущая цена акции, если выплачиваемый по ней годовой дивиденд составляет 120 тысяч рублей, а депозитный процент – 12%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 17

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Инвестиционная фаза инвестиционного проекта и ее стадии.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Объясните, на основании каких данных выбираются потенциальные виды финансовых активов для включения их в «портфель».

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

На счете в банке 1,0 миллион рублей. Банк платит 9,0% годовых. Целесообразно ли входить этим капиталом в бизнес, если прогнозируется удвоение капитала через 5 лет.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 18

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Фаза эксплуатации в инвестиционном цикле инвестиционного проекта

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Как объяснить тот факт, что одна денежная единица, истраченная сегодня стоит больше, чем, например, через год?

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Проект, рассчитан на 15 лет и требует инвестиций в размере 150000 рублей. В первые 4 года поступлений не ожидается. В следующие 10 лет ежегодный доход составит 40000 рублей. Принимать ли этот проект, если коэффициент дисконтирования равен 15%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 19

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

ТЭО и его исходные позиции.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Объясните роль человеческого фактора в определении «наилучших ценных бумаг».

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Целесообразно ли для инвестора приобретение дополнительных акций или, наоборот, продажа имеющихся, если ежегодные дивиденды, выплачиваемые по ним, составляют 110 тыс. руб., текущая рыночная стоимость каждой акции составляет 350 тыс. руб., а рыночная ставка дохода оценивается в 20% годовых.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 20

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:
Формулирование целей и определение критериев оценки инвестиционного проекта.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Обоснуйте взаимосвязь трёх элементов инвестиционного процесса (финансовые инвестиции).
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Стоит ли акционеру продать имеющиеся акции и положить деньги на депозит, если ежегодные дивиденды, выплачиваемые по ним, составляют 50 тыс. руб., текущая рыночная стоимость каждой акции составляет 500 тыс. руб., а ставка дохода по депозитам оценивается в 10% годовых?

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 21

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Инвестиционный климат и инвестиционная привлекательность в иерархической системе хозяйствования.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните, с чем связана необходимость учёта фактора времени при сопоставлении в проектном анализе затрат и доходов?
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
На счете в банке 2,0 миллиона рублей. Банк платит 10,0% годовых. Целесообразно ли входить этим капиталом в бизнес, если прогнозируется удвоение капитала через 5 лет.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 22

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Пять этапов (ступеней) инвестиционного процесса.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Обоснуйте, какой тип инвестиционного портфеля выбирается, если перед фирмой стоит цель устойчивого, стабильного развития?

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Целесообразна ли реализация инвестиционного проекта, если фирма получает инвестиционный кредит в размере 400 тыс.рублей на четырёхлетний период и планирует ежегодно получать чистый денежный поток от реализации проекта в размере 110 тыс. рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 23

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Отличие метода окупаемости от методов чистой дисконтированной стоимости и внутренней нормы доходности.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Докажите необходимость учёта фактора времени при оценке инвестиционных проектов.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
В соответствии с принятой дивидендной политикой компания ограничила выплату дивидендов в предстоящие три года общей суммой в 980 руб. В последующие пять лет оно обязалось выплачивать ежегодные дивиденды в размере 100 руб. Норма ожидаемой доходности акции данного типа составляет 25% в год. Определите текущую рыночную стоимость акции.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 24

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Оценка инвестиций по внутренней норме доходности.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Какая схема инвестирования из двух предпочтительнее, если инвестируется проект на действующем предприятии за счёт заёмных средств?

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Имеет ли смысл инвестору приобрести дополнительно эти акции или, наоборот, продать имеющиеся, если ежегодные дивиденды, выплачиваемые по акции, составляют 100 тыс. руб., текущая рыночная стоимость каждой акции составляет 500 тыс. руб., а ставка дохода по депозитам оценивается в 10% годовых.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 25

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Виды ценных бумаг и их доходность.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Обоснуйте, какой тип инвестиционного портфеля выбирается, если перед фирмой стоит цель быстрого роста?

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

На счете в банке 1,5 миллион рублей. Банк платит 12,0% годовых. Целесообразно ли входить этим капиталом в бизнес, если прогнозируется удвоение капитала через 5 лет.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 26

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Норма дисконта и ее определение

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Оценка риска с учетом использования в инвестициях собственного и заемного капитала.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Проект, рассчитан на 15 лет и требует инвестиций в размере 150000 рублей. В первые 4 года поступлений не ожидается. В следующие 10 лет ежегодный доход составит 40000 рублей. Принимать ли этот проект, если коэффициент дисконтирования равен 15%.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 27

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:
Основной капитал как объект инвестирования: сущность, состав, структура
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните, чем характеризуется общее и особенное в определении NPV и IRR?
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Целесообразна ли реализация инвестиционного проекта, если фирма получает инвестиционный кредит в размере 500 тыс.рублей на четырёхлетний период и планирует ежегодно получать чистый денежный поток от реализации проекта в размере 120 тыс.рублей.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 28

1. Задание для проверки уровня «ЗНАТЬ» - 0 или 1 или 2 балла:

Оценка эффективности управления инвестиционным портфелем

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Объясните, какой метод оценки инвестиций предпочтителен при привлечении венчурных инвестиций.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Рассчитайте на условном примере средневзвешенную стоимость капитала.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Кафедра «Экономика и управление производством»

Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»

Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 29

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:

Инновации и инвестиции: характер взаимосвязи.

2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

Объясните необходимость перехода к преимущественно инновационному типу развития экономики.

3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:

С помощью, каких показателей определяется характер обновления основного капитала? Проиллюстрируйте на условном примере.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

«отлично» - при сумме баллов 5 или 6;

«хорошо» - при сумме баллов 4;

«удовлетворительно» - при сумме баллов 3;

«неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»

Специальность: 38.05.01 Экономическая безопасность
Профиль: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Кафедра «Экономика и управление производством»
Дисциплина «Анализ эффективности инвестиционной деятельности»
Семестр 7

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 30

1. Вопрос для проверки уровня «ЗНАТЬ» – 0 или 1 или 2 балла:
Техническое перевооружение, реконструкция, модернизация предприятий промышленности и инвестирование.
2. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
Объясните возможные преимущества или недостатки кредитования инвестиций по отношению к лизингу.
3. Задание для проверки уровня «УМЕТЬ» - 0 или 2 балла:
С помощью, каких показателей определяется эффективность использования основного капитала? Проиллюстрируйте на условном примере.

Критерии итоговой оценки за экзамен:

- «отлично» - при сумме баллов 5 или 6;
- «хорошо» - при сумме баллов 4;
- «удовлетворительно» - при сумме баллов 3;
- «неудовлетворительно» - при сумме баллов 0, 1 или 2.

Составитель: д.э.н.

Г.А. Александров

Заведующий кафедрой: д.э.н.

И.В. Вякина

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тверской государственный технический университет»
(ТвГТУ)

УТВЕРЖДАЮ:
Заведующий кафедрой ЭУП

(подпись)

д.э.н., доцент И.В. Вякина

« ____ » _____ 2022 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

_____ курсового проекта _____

(промежуточной аттестации: экзамен, зачет, курсовая работа или курсовой проект; практики: с указанием вида и типа практики; государственного экзамена)

Анализ эффективности инвестиционной деятельности

Наименование дисциплины (для промежуточной аттестации)

Специалитет 38.05.01 Экономическая безопасность

Направленность (профиль) – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Типы задач профессиональной деятельности: информационно-аналитический, организационно-управленческий, научно-исследовательский

Разработаны в соответствии с:
рабочей программой дисциплины,
утвержденной 05.07.2022 г.

Разработчик: Александров Г.А.

Тверь 2022

Индикаторы компетенции:

ИПК-3.1. Проводит оценку инвестиционных проектов, комплексный анализ эффективности инвестиционной деятельности и инвестиционных рисков;

Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций:**Знать:**

3.1.1. Методологические основы выявления факторов, определяющих привлекательность инвестиционного климата и инвестиционных рисков;

3.1.2. Основные способы формирования инвестиционных ресурсов организаций (предприятий).

Уметь:

У.1.1. Осуществлять поиск и сбор информации, необходимой для оценки инвестиционных проектов;

У.1.2. Проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности и инвестиционных рисков и выявлять факторы, формирующие инвестиционную привлекательность объектов инвестирования;

У.1.3. Обосновывать свои решения.

Владеть:

В.1.1. Основными методами и средствами диагностики инвестиционного климата и оценки инвестиционных рисков как объективной основы определения уровня обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов.

Таблица. Оцениваемые показатели для проведения промежуточной аттестации в форме курсовой работы

№ раздела	Наименование раздела	Баллы по шкале уровня
	Введение	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
1	Глава 1 (теоретическая)	Выше базового – 6 Базовый – 3 Ниже базового – 0
2	Глава 2 (аналитическая)	Выше базового – 6 Базовый – 3 Ниже базового – 0
3	Глава 3 (конкретные предложения и обоснование целесообразности их реализации)	Выше базового – 6 Базовый – 3 Ниже базового – 0
	Заключение	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0
	Список использованных источников	Выше базового – 2 Базовый – 1 Ниже базового – 0

Критерии итоговой оценки за курсовой проект:

«отлично» – при сумме баллов от 22 до 24;

«хорошо» – при сумме баллов от 17 до 20;

«удовлетворительно» – при сумме баллов от 12 до 16;

«неудовлетворительно» – при сумме баллов менее 11, а также при любой другой сумме, если по разделу «Специальная часть», работа имеет 0 баллов, а также если в работе выявлено недобросовестное заимствование (оригинальность текста менее 70%) или структура работы не соответствует представленным выше требованиям.