

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://stuservis.ru/kontrolnaya-rabota/79475>

Тип работы: Контрольная работа

Предмет: Инвестиционный менеджмент

Задача 1 3

Задача 2 4

Задача 3 4

Задача 4 5

Задача 5 6

Задача 6 7

Задача 7 8

Задача 8 9

Задача 9 10

Задача 10 11

Задача 11 12

Список литературы 14

Задача 1.

Уставный капитал акционерного общества в размере 5 млн. руб. состоит на 80% из обыкновенных и на 20% из привилегированных акций. Номинальная стоимость обыкновенной акции составляет 1 000 руб., привилегированной 5 000 руб. Размер прибыли к распределению между акционерами – 1,2 млн. руб. По привилегированным акциям установлена фиксированная ставка дивиденда в размере 15 %. Определите, размер дивидендов, которые будут выплачены в расчёте на одну обыкновенную и одну привилегированную акции.

Задача 2.

Акционерное общество зарегистрировало 10 000 обыкновенных акций, из которых 8 500 было продано акционерам. Через некоторое время общество выкупило у инвесторов 500 акций. По окончании отчетного года собранием акционеров принято решение о распределении в качестве дивидендов 12 млн. руб. прибыли. Определите сумму дивиденда на одну акцию.

Задача 3.

Облигация номинальной стоимостью 10 000 руб. выпущена на 3 года, купонная ставка доходности составляет 14%. Цена первичного размещения облигации 9 300 руб. Определите величину банковской ставки, при которой инвестору выгодно купить облигацию.

Задача 4.

Имеются три схемы инвестирования денежных средств:

1. Вложение на 10 дней под 8 % годовых с последующим реинвестированием полученных денежных средств каждую декаду в течение месяца.
2. Вложение на 1 день под 6 % годовых с последующим ежедневным реинвестированием денежных средств на таких же условиях в течение месяца.
3. Вложение на 1 месяц под 12 % годовых.

Определите, какая из схем инвестирования денежных средств является наиболее выгодной (без учета налогообложения).

Задача 5.

Инвестор приобрел 100 облигаций компании «А» номиналом 150 000 руб. при ставке купонного дохода 17 % и 50 облигаций компании «В» номиналом 200 000 руб. при ставке купонного дохода 22 %. За год инвестором был получен доход по ценным бумагам (купонный и от погашения облигаций), который был направлен на покупку акций компании «С» номинальной стоимостью 10 000 руб. Определите, какое

количество акций компании «С» приобрел инвестор.

Задача 6.

Какую сумму необходимо сегодня инвестировать в банк, чтобы через год получить 300 000 руб. при ежемесячном начислении процентов по вкладу. Номинальная годовая процентная ставка 7 %.

Задача 7.

Инвестор приобрел облигацию компании «А» номинальной стоимостью 20 000 руб. с дисконтом 5%, проценты начисляются ежегодно по ставке 14 %. Через год облигация была погашена, а полученные средства были инвестированы в акцию компании «В» номинальной стоимостью 18 000 руб. Через год по акции был получен дивиденд по ставке 20 %, после чего акция была продана на 15 % дороже цены приобретения. Все полученные доходы инвестором размещены на 4 месяца в банковском вкладе с ежемесячным начислением процентов в размере 10 % годовых. Определите эффективность вложений за весь срок инвестирования.

Задача 8.

Портфель инвестора состоит из обыкновенных акций компаний «А», «В», «С» и «D».

Наименование

акций в портфеле Количество акций в портфеле, шт. Рыночная

стоимость акции,

руб. Ожидаемая через год стоимость

акций, руб.

«А» 100 1 000 1 120

«В» 150 2 000 2 350

«С» 125 1 500 1 750

«D» 175 3 000 3 500

Определите ожидаемую через год доходность портфеля ценных бумаг.

Задача 9.

Облигация номинальной стоимостью 10 000 руб. и сроком погашения через 5 лет приобретена по цене 12 500 руб. Выплата текущего дохода производится раз в год по ставке 10 %. Получаемые текущие доходы по облигации зачисляются на банковский вклад с ежегодным начислением процентов по ставке 12 % годовых. Определите эффективность вложений за весь срок инвестирования.

Задача 10.

Акция номинальной стоимостью 25 000 руб. и ставкой дивиденда 15% приобретена по курсу 1,3 и продана через год. Доход инвестора составил 0,3 рубля с каждого инвестированного рубля. Определите курс акции.

Задача 11.

Акция номинальной стоимостью 8 000 руб. куплена по курсу 1,22 и продана владельцем через 3 года на 26 % дороже цены приобретения. В первый год текущая доходность вложений составила 17 %, во второй год ставка объявленных эмитентом дивидендов равнялась 19 %. Определите совокупную доходность инвестиций за весь срок инвестирования.

Задача 1

Уставный капитал акционерного общества в размере 5 млн. руб. состоит на 80% из обыкновенных и на 20% из привилегированных акций. Номинальная стоимость обыкновенной акции составляет 1 000 руб., привилегированной 5 000 руб. Размер прибыли к распределению между акционерами – 1,2 млн. руб. По привилегированным акциям установлена фиксированная ставка дивиденда в размере 15 %. Определите, размер дивидендов, которые будут выплачены в расчете на одну обыкновенную и одну привилегированную акции.

Решение:

Определим согласно удельному весу стоимость акций в уставном капитале:

- обыкновенных: $5000000 \cdot 80 / 100 = 4000000$ руб.;

- привилегированных: $5000000 \cdot 20 / 100 = 1000000$ руб.

Количество акций определим делением их общей стоимости на номинальную стоимость единицы:

- обыкновенных: $4000000 / 1000 = 4000$ ед.;

- привилегированных: $1000000 / 5000 = 200$ ед.

По привилегированным акциям фиксированная ставка дивиденда установлена в процентах от номинала, тогда на одну акцию приходится:

$5000 \cdot 15 / 100 = 750$ руб.

Общая сумма дивидендов по привилегированным акциям:

$750 \cdot 200 = 150000$ руб.

Определим остаток прибыли к распределению на обыкновенные акции:

$1200000 - 150000 = 1050000$ руб.

Если обыкновенных акций 4000 ед., тогда дивиденд на одну акцию составит:

$1050000 / 4000 = 262,5$ руб.

Ответ: размер дивиденда на одну обыкновенную акцию 262,5 руб., на одну привилегированную – 750 руб.

Задача 2

Акционерное общество зарегистрировало 10 000 обыкновенных акций, из которых 8 500 было продано акционерам. Через некоторое время общество выкупило у инвесторов 500 акций. По окончании отчетного года собранием акционеров принято решение о распределении в качестве дивидендов 12 млн. руб. прибыли. Определите сумму дивиденда на одну акцию.

Решение:

Определим число акций в обращении как разницу между проданными и выкупленными назад:

$8500 - 500 = 8000$ акций.

По акциям, которые на балансе АО (это $1000 - 8500 + 500 = 2000$ акций), дивиденд не выплачивается. То есть дивиденд на каждую акцию, которая находится в обращении, составит:

$12000000 / 8000 = 1500$ руб.

Ответ: сумма дивиденда на одну акцию 1500 руб.

1. Герасимова Е.Б., Редин Д.В. Финансовый анализ. Управление финансовыми операциями. – М.: Форум, 2017. – 192с.
2. Григорьева Т.И. Финансовый анализ для менеджеров: оценка, прогноз: Учебник. – М.: Юрайт, 2017. – 486с.
3. Ендовицкий Д.А., Щербакова Н.Ф., Исаенко А.Н. Финансовый менеджмент: Учебник. – М.: Рид Групп, 2016. – 800с.
4. Забелина О.В., Толкаченко Г.Л. Финансовый менеджмент – М.: Издательство «Экзамен», 2015. – 298с.
5. Найденова Р.И., Виноходова А.Ф., Найденов А.И. Финансовый менеджмент: Учебное пособие. – М.: КноРус, 2017. – 208с.

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://stuservis.ru/kontrolnaya-rabota/79475>