

Задание по теме 9

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 8%. 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.