

Методические рекомендации по выполнению индивидуального задания и варианты

Модуль «Экономика инвестиций»

При выполнении индивидуального задания обучающемуся необходимо руководствоваться лекционным материалом, особое внимание следует уделить лекциям №15 и №20, а также примерам, приведенным в них.

Индивидуальное задание должно быть представлено документом Microsoft Office Word и содержать следующее:

- титульный лист;
- условия задачи согласно варианту;
- подробное решение;
- ответ и вывод.

Вариант 1

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 11%, данные в млн. руб.:

проект А: -110; 60; 80;

проект В: -120; 20; 60; 50.

Вариант 2

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 12%, данные в млн. руб.:

проект А: -100; 40; 70;

проект В: -100; 20; 50; 50.

Вариант 3

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 13%, данные в млн. руб.:

проект А: -110; 60; 60;

проект В: -120; 40; 30; 70.

Вариант 4

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 550 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 14% ($r = 14\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-210	90	110	190
Б	-230	90	160	170
В	-240	150	130	120

Вариант 5

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 550 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 15% ($r = 15\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-220	70	110	160
Б	-230	110	170	150
В	-215	130	135	105

Вариант 6

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 420 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 16% ($r = 16\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-210	70	80	110
Б	-250	60	140	90
В	-190	130	80	105

Вариант 7

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 14%, данные в млн. руб.:

проект А: -90; 55;45;

проект В: -100; 30; 40; 40.

Вариант 8

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 15%, данные в млн. руб.:

проект А: -110; 60; 60;

проект В: -110; 30; 35; 55.

Вариант 9

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 16%, данные в млн. руб.:

проект А: -120; 60; 80;

проект В: -130; 60; 50; 40.

Вариант 10

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 600 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 17% ($r = 17\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-210	90	110	190
Б	-230	110	190	150
В	-215	150	150	110

Вариант 11

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 700 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 18% ($r = 18\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-300	180	150	180
Б	-260	102	170	120
В	-210	135	125	150

Вариант 12

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 800 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 19% ($r = 19\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-300	130	150	170
Б	-350	110	190	160
В	-280	160	145	112

Вариант 13

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 20%, данные в млн. руб.:

проект А: -200; 150; 170;

проект В: -210; 130; 240; 160.

Вариант 14

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 21%, данные в млн. руб.:

проект А: -300; 150; 170;

проект В: -300; 230; 140; 60.

Вариант 15

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 22%, данные в млн. руб.:

проект А: -400; 240; 280;

проект В: -420; 230; 220; 60.

Вариант 16

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 800 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 23% ($r = 23\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-300	90	200	160
Б	-350	120	190	240
В	-320	240	120	110

Вариант 17

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 700 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 24% ($r = 24\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-260	120	130	280
Б	-290	130	140	270
В	-320	140	150	260

Вариант 18

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 1000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 25% ($r = 25\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-400	280	200	170
Б	-440	300	280	150
В	-420	240	250	120

Вариант 19

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 30%, данные в млн. руб.:

проект А: -1000; 550; 590;

проект В: -1000; 430; 440; 260.

Вариант 20

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 29%, данные в млн. руб.:

проект А: -2000; 1650; 570;

проект В: -2100; 1230; 940; 260.

Вариант 21

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 28%, данные в млн. руб.:

проект А: -3000; 1550; 1750;

проект В: -3200; 1330; 1450; 260.

Вариант 22

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 1200 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 27% ($r = 27\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-500	380	300	360
Б	-540	400	280	220
В	-520	440	310	180

Вариант 23

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 2200 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 26% ($r = 26\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1100	560	400	420
Б	-1300	600	360	450
В	-1280	610	410	470

Вариант 24

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 4330 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 10% ($r = 10\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2500	680	1100	1980
Б	-1890	700	1180	1940
В	-1450	840	1140	700

Вариант 25

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 19%, данные в млн. руб.:

проект А: -1100; 950; 670;

проект В: -1000; 700; 400; 400.

Вариант 26

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 18%, данные в млн. руб.:

проект А: -4200; 2250; 3270;

проект В: -5000; 3520; 1440; 2560.

Вариант 27

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 17%, данные в млн. руб.:

проект А: -7000; 5200; 4300;

проект В: -8000; 3450; 4350; 3360.

Вариант 28

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 10000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 16% ($r = 16\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-5200	4280	3200	5280
Б	-4240	4100	3900	5640
В	-6220	5140	3500	5800

Вариант 29

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 6000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 15% ($r = 15\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2000	2080	3400	1180
Б	-3240	1900	2280	3140
В	-4220	2100	3140	2000

Вариант 30

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 8000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 14% ($r = 14\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-4000	2280	1600	3000
Б	-2540	3000	1800	4140
В	-3560	2150	1400	3100

Вариант 31

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 13%, данные в млн. руб.:

проект А: -2000; 5000; 700;

проект В: -3000; 3000; 4000; 600.

Вариант 32

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 12%, данные в млн. руб.:

проект А: -200; 100; 140;

проект В: -200; 60; 80; 120.

Вариант 33

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 11%, данные в млн. руб.:

проект А: -300; 170; 180;

проект В: -250; 130; 140; 90.

Вариант 34

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 6000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 11% ($r = 11\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-3300	900	1800	3600
Б	-2500	1000	2000	4000
В	-4050	500	2500	5000

Вариант 35

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 7000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 12% ($r = 12\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2600	2300	1500	2300
Б	-4200	2600	1800	2100
В	-3600	2700	1100	2000

Вариант 36

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 8000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 13% ($r = 13\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-4500	1200	3600	3000
Б	-3200	2500	2000	2300
В	-2900	1900	2100	2100

Вариант 37

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 14%, данные в млн. руб.:

проект А: -3100; 5000; 2350;

проект В: -3500; 5500; 1900; 1660.

Вариант 38

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 15%, данные в млн. руб.:

проект А: -4200; 3500; 3770;

проект В: -4100; 3300; 2200; 1200.

Вариант 39

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 16%, данные в млн. руб.:

проект А: -4200; 2550; 4700;

проект В: -4000; 3000; 1400; 1660.

Вариант 40

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 5000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 17% ($r = 17\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2100	800	2000	1000
Б	-2140	1000	2100	900
В	-2300	1000	2200	1100

Вариант 41

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 2000 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 18% ($r = 18\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1200	1000	400	300
Б	-1300	900	300	400
В	-900	500	200	500

Вариант 42

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 2500 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 19% ($r = 19\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1900	1000	900	500
Б	-1300	900	700	800
В	-1400	800	900	900

Вариант 43

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 20%, данные в млн. руб.:

проект А: -700; 450; 570;

проект В: -650; 430; 220; 160.

Вариант 44

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 21%, данные в млн. руб.:

проект А: -800; 500; 450;

проект В: -800; 400; 380; 260.

Вариант 45

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 22%, данные в млн. руб.:

проект А: -150; 90; 90;

проект В: -160; 70; 75; 85.

Вариант 46

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 1300 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 23% ($r = 23\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1000	200	800	400
Б	-700	300	450	500
В	-500	200	250	150

Вариант 47

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 1400 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 24% ($r = 24\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-900	300	500	580
Б	-300	100	300	200
В	-500	200	150	300

Вариант 48

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 1500 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 25% ($r = 25\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-850	200	550	300
Б	-930	305	560	400
В	-720	245	530	420

Вариант 49

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 24%, данные в млн. руб.:

проект А: -1120; 950; 870;

проект В: -1150; 630; 510; 260.

Вариант 50

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 23%, данные в млн. руб.:

проект А: -1300; 750; 970;

проект В: -1420; 830; 740; 260.

Вариант 51

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 22%, данные в млн. руб.:

проект А: -1150; 550; 960;

проект В: -1200; 950; 420; 160.

Вариант 52

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 7100 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 21% ($r = 21\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2900	1900	700	1800
Б	-3200	2000	1200	850
В	-4000	1500	3000	2500

Вариант 53

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 6300 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 20% ($r = 20\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-3200	1600	1500	450
Б	-1200	600	850	700
В	-3000	1200	1500	1600

Вариант 54

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 5400 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 19% ($r = 19\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-2600	1780	1100	900
Б	-3000	1600	1700	850
В	-2900	1300	1260	1400

Вариант 55

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 18%, данные в млн. руб.:

проект А: -620; 340; 490;

проект В: -650; 330; 240; 260.

Вариант 56

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 17%, данные в млн. руб.:

проект А: -710; 450; 480;

проект В: -800; 330; 430; 260.

Вариант 57

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 16%, данные в млн. руб.:

проект А: -210; 150; 170;

проект В: -220; 130; 140; 135.

Вариант 58

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 4500 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 15% ($r = 15\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-3000	2180	900	700
Б	-2240	1500	1000	540
В	-1120	600	500	1000

Вариант 59

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 3600 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 14% ($r = 14\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1400	750	620	180
Б	-1600	900	500	400
В	-1200	700	740	200

Вариант 60

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 2100 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 13% ($r = 13\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-1000	400	550	600
Б	-900	300	500	350
В	-1100	600	450	350

Вариант 61

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 12%, данные в млн. руб.:

проект А: -500; 350; 270;

проект В: -480; 230; 240; 260.

Вариант 62

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 11%, данные в млн. руб.:

проект А: -470; 250; 370;

проект В: -450; 230; 340; 160.

Вариант 63

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 10%, данные в млн. руб.:

проект А: -450; 260; 290;

проект В: -420; 230; 270; 110.

Вариант 64

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 800 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 9% ($r = 9\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-250	75	120	140
Б	-330	110	220	90
В	-420	210	130	150

Вариант 65

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 600 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 8% ($r = 8\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-180	90	75	110
Б	-210	130	90	110
В	-350	150	170	120

Вариант 66

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 900 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 10% ($r = 10\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-250	100	90	200
Б	-320	110	80	300
В	-420	110	60	400

Вариант 67

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 11%, данные в млн. руб.:

проект А: -600; 450; 370;

проект В: -630; 330; 440; 60.

Вариант 68

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 12%, данные в млн. руб.:

проект А: -400; 250; 390;

проект В: -380; 230; 150; 155.

Вариант 69

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 13%, данные в млн. руб.:

проект А: -210; 130; 160;

проект В: -220; 90; 100; 70.

Вариант 70

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 300 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 14% ($r = 14\%$). Рассматриваемые проекты поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-120	60	50	100
Б	-160	80	90	150
В	-180	85	115	90

Вариант 71

Сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на инвестирование в плановом году 200 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 15% ($r = 15\%$). Рассматриваемые проекты не поддаются дроблению.

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-90	50	40	90
Б	-85	55	45	100
В	-110	60	65	115

Вариант 72

Провести временную оптимизацию и сформировать оптимальный инвестиционный портфель предприятия, если имеется три независимых проекта А, Б, В (таблица 1). Предприятие планирует направить на

инвестирование в плановом году 180 д.е. Предполагаемая «цена» капитала 16% ($r = 16\%$).

Таблица 1 - Исходные данные по проектам

Проект	Инвестиции, д.е.	Доходы по годам, д.е.		
		1-й	2-й	3-й
А	-105	30	90	110
Б	-60	20	50	60
В	-70	40	30	80

Вариант 73

Требуется определить методом цепного повтора в рамках общего срока действия проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 17%, данные в млн. руб.:

проект А: -600; 550; 180;

проект В: -700; 530; 120; 150.

Вариант 74

Требуется определить методом бесконечного цепного повтора сравниваемых проектов наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 18%, данные в млн. руб.:

проект А: -350; 210; 310;

проект В: -380; 200; 100; 145.

Вариант 75

Требуется определить методом эквивалентного аннуитета наиболее предпочтительный проект, если цена капитала составляет 19%, данные в млн. руб.:

проект А: -230; 145; 210;

проект В: -205; 90; 80; 200.