1. До погашения купонной облигации осталось 4 месяца. Номинал облигации 1000 руб., облигация приобретена по чистой цене 920 руб. Годовой купонный доход составляет 50 руб. купоны выплачиваются 2 раза в год, купонный период: 180 дней, база: 360 дней. Какова эффективная годовая доходность облигации к погашению?
2. Инвестор покупает облигацию номиналом 1000 руб. и купонной ставкой 10% по рыночной цене. Срок до погашения 2 года, ставка дисконтирования составляет 8% годовых. На следующий день ставка дисконтирования выросла на 2%. Рассчитать на сколько изменится рыночная цена облигации через показатель дюрации.
3. Рыночная капитализация компании равна 1200 млн. руб., рыночная стоимость долгосрочного долга (в том числе та его часть, которая погашается в текущем году) – 300 млн. руб., ликвидные денежные средства на балансе – 200 млн. руб., количество размещенных акций – 10 млн. шт. Определить стоимость компании в расчете на одну акцию.
4. На фондовой бирже обращаются 800 тыс.шт. обыкновенных акций номиналом 10руб. и 100 тыс.шт. привилегированных акций номиналом 20 руб. компании ПАО «Парус». Курсовая стоимость обыкновенных акций составляет 100 руб., а привилегированных 80 руб. В отчетном периоде выручка компании составила 120 млн. руб., чистая прибыль – 22 млн. руб., стоимость чистых активов – 88 млн. руб. Определить коэффициенты (мультипликаторы): Ккомп /ЧП; Ккомп /S; Ккомп /СЧА.
5. Удельный вес актива X в портфеле равен 15%, актива Y равен 35%, стандартное отклонение доходности актива X равно 5%, актива Y равно 4%, актива Z равно 6%, ковариация доходностей активов X и Y равна 15, X и Z равна 20, Y и Z равна 12. Определить риск портфеля, измеренный стандартным отклонением.

***Оформление задач на листе А4:***  *Группа, ФИО, № варианта,*

*Пункты решения каждой задачи:*

* *Порядковый номер задачи*
* ***Дано****: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_(в любых символах исходные данные из условия задачи)*
* ***Решение****: алгоритм (формула) решения*
* *Подстановка исходных данных в конечную формулу*
* ***ОТВЕТ:\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_***