

Министерство сельского хозяйства Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Санкт-Петербургский государственный аграрный университет»

**Институт экономики и управления
Кафедра экономики и бухгалтерского учёта**

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
текущего контроля/промежуточной аттестации обучающихся при
освоении ОПОП ВО**

по дисциплине
«Системный анализ в управлении»

Уровень высшего образования
МАГИСТРАТУРА

**Направление подготовки
38.04.02 Менеджмент**

**Направленность (профиль) образовательной программы
Проектный менеджмент**

Очная, очно-заочная формы обучения

Год начала подготовки – 2025

Санкт-Петербург
2025 г.

1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Таблица 1

№	Формируемые компетенции	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Оценочное средство
1.	<p>УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий.</p> <p>ИУК-1.4. Выстраивает сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения.</p> <p>знать: подходы к разработке сценариев формирования и реализации стратегии, определяя возможные риски;</p> <p>уметь: разрабатывать сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их минимизации;</p> <p>владеть: навыками формирования сценариев реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их минимизации.</p>	<p>Раздел 1.</p> <p>Раздел 2.</p>	Тесты
2	<p>ПК-1. Способен принимать оптимальные стратегические решения в области управление рисками организаций.</p> <p>ИПК-1.1. Проектирует системы управления рисками хозяйствующих субъектов.</p> <p>знать: национальные и международные стандарты по построению систем управления рисками;</p> <p>уметь: разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками в соответствии с национальными и международными стандартами;</p> <p>владеть: навыками проектирования структуры системы управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организаций.</p>	<p>Раздел 1.</p> <p>Раздел 2.</p>	Тесты
3	<p>ПК-2. Разрабатывает методическое обеспечение и осуществляет координацию процесса управления рисками.</p> <p>ИПК-2.3. Оценивает эффективность воздействия на риск в избранной профессиональной сфере.</p> <p>знать: методы и инструментарий анализа эффективности воздействия на риск в избранной профессиональной сфере;</p> <p>уметь: проводить оценку эффективности воздействия на риск;</p> <p>владеть: навыками оценки эффективности воздействия на риск.</p>	<p>Раздел 1.</p> <p>Раздел 2.</p>	Тесты

2. ПРИМЕРНЫЙ ПЕРЕЧЕНЬ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Таблица 2

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
1.	Тест	Система стандартизованных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося	Фонд тестовых заданий

3. ПОКАЗАТЕЛИ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ НА РАЗЛИЧНЫХ ЭТАПАХ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Таблица 3

Планируемые результаты освоения компетенции	Уровень освоения				Оценочное средство	
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично		
УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий						
ИУК-1.4. Выстраивает сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения						
Знать подходы к разработке сценариев формирования и реализации стратегии, определяя возможные риски	Уровень знаний неудовлетворительный, имеются серьезные и существенные ошибки	Минимально допустимый уровень знаний, допущены отдельные негрубые ошибки	Уровень знаний средний с отдельными негрубыми ошибками	Уровень знаний в отличный без ошибок	Тесты	
Уметь разрабатывать сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их минимизации	При решении заданий отсутствуют необходимые умения, допущены серьезные ошибки	Показаны минимальные умения при решении тестов с отдельными серьезными ошибками	Показаны основные умения при решении заданий, задания решены с отдельными негрубыми ошибками	Показаны отличные умения, решены все задания практически без ошибок	Тесты	
Владеть навыками формирования сценариев реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их минимизации	При решении заданий отсутствуют базовые навыки, допущены серьезные ошибки	Имеются минимальные навыки для решения заданий с отдельными серьезными ошибками	Показаны хорошие навыки при решении заданий, но с допущением отдельных ошибок	Показаны отличные навыки при решении заданий практически без ошибок	Тесты	
ПК-1. Способен принимать оптимальные стратегические решения в области управление рисками организаций						
ИПК-1.1. Проектирует системы управления рисками хозяйствующих субъектов						
Знать национальные и международные стандарты по построению систем управления рисками.	Уровень знаний неудовлетворительный, имеются серьезные и существенные ошибки	Минимально допустимый уровень знаний, допущены отдельные негрубые ошибки	Уровень знаний средний с отдельными негрубыми ошибками	Уровень знаний в отличный без ошибок	Тесты	

Уметь разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками в соответствии с национальными и международными стандартами.	При решении тестов отсутствуют необходимые умения, допущены серьезные ошибки	Показаны минимальные умения при решении тестов с отдельными серьезными ошибками	Показаны основные умения при решении тестов, задания решены с отдельными негрубыми ошибками	Показаны отличные умения, решены все задания практически без ошибок	Тесты
Владеть навыками проектирования структуры системы управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	При решении тестов отсутствуют базовые навыки, допущены серьезные ошибки	Имеются минимальные навыки для решения заданий с отдельными серьезными ошибками	Показаны хорошие навыки при решении заданий, но с допущением отдельных ошибок	Показаны отличные навыки при решении заданий практически без ошибок	Тесты
ПК-2. Разрабатывает методическое обеспечение и осуществляет координацию процесса управления рисками					
ИПК-2.3. Оценивает эффективность воздействия на риск в избранной профессиональной сфере					
Знать методы и инструментарий анализа эффективности воздействия на риск в избранной профессиональной сфере	Уровень знаний неудовлетворительный, имеются серьезные и существенные ошибки	Минимально допустимый уровень знаний, допущены отдельные серьезные ошибки	Уровень знаний средний с отдельными негрубыми ошибками	Уровень знаний в отличный без ошибок	Тесты
Уметь проводить оценку эффективности воздействия на риск.	При решении тестов отсутствуют необходимые умения, допущены серьезные ошибки	Показаны минимальные умения при решении тестов с отдельными серьезными ошибками	Показаны основные умения при решении тестов, задания решены с отдельными негрубыми ошибками	Показаны отличные умения, решены все задания практически без ошибок	Тесты
Владеть навыками оценки эффективности воздействия на риск.	При решении тестов отсутствуют базовые навыки, допущены серьезные ошибки	Имеются минимальные навыки для решения заданий с отдельными серьезными ошибками	Показаны хорошие навыки при решении заданий, но с допущением отдельных ошибок	Показаны отличные навыки при решении заданий практически без ошибок	Тесты

4. ПЕРЕЧЕНЬ КОНТРОЛЬНЫХ ЗАДАНИЙ И ИНЫХ МАТЕРИАЛОВ, НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ

4.1. Типовые задания для текущего контроля успеваемости

4.1.1. Тесты

УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий.

ИУК-1.4. Выстраивает сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения

1. Стратегия организации – это:
 - a) деятельность организации в определенной стратегической зоне хозяйствования (определенный сегмент рынка);
 - b) практическое использование методологии стратегического управления;
 - c) генеральный план действий, определяющий приоритеты стратегических задач, ресурсы и последовательность шагов по достижению стратегических целей;
 - d) обеспечение выработки действий для достижения целей организации и создание управлеченческих механизмов реализации этих действий через систему планов.
2. Сценарный анализ интегрирует данные анализа внешней и внутренней среды компании, так ли это:
 - a) отчасти;
 - b) нет;
 - c) да.
3. Ассортиментный набор, предлагаемый в рамках стратегии лидерства по издержкам:
 - a) удовлетворение особых нужд сегмента;
 - b) качественный базовый продукт;
 - c) гармоничная номенклатура.
4. Важным элементом организационной культуры является ... этических норм и ценностей:
 - a) план;
 - b) индивид;
 - c) система;
 - d) совокупность.
5. Совокупность направленной и адаптированной стратегии – это такая стратегия:
 - a) возникающая;

- b) реальная;
 - c) реактивная.
6. Условия, при выполнении которых фокусирование обеспечивает компании конкурентные преимущества, – это условия ... фокусирования:
- a) целесообразности;
 - b) нецелесообразности;
 - c) плановости;
 - d) системности.
7. К факторам мезосреды относится:
- a) планировщики;
 - b) производство;
 - c) поставщики ресурсов;
 - d) административный персонал.
8. Организации находятся в состоянии постоянного обмена с внешней средой, обеспечивая тем самым себе возможность выживания, так ли это:
- a) отчасти;
 - b) да;
 - c) нет.
9. Внешняя среда является источником, питающим организацию ресурсами, которые необходимы для поддержания ее внутреннего потенциала на должном уровне, так ли это:
- a) да;
 - b) отчасти;
 - c) нет.
- 10.Процесс постановки целей в стратегическом менеджменте происходит:
- a) сверху вниз и по горизонтали;
 - b) снизу-вверх;
 - c) сверху вниз;
 - d) по горизонтали.
- 11.Миссия компании должна определять:
- a) сферу деятельности компании;
 - b) стратегические и финансовые цели;
 - c) ожидаемые издержки и прибыль.
- 12.Если будущее может быть предсказано путем экстраполяции исторически сложившихся тенденций роста, то это:
- a) стратегическое планирование;
 - b) среднесрочное планирование;
 - c) долгосрочное планирование;
 - d) другой ответ.
- 13.Если важное место отводится анализу перспектив организации, задачей которого является выяснение тех тенденций, опасностей, возможностей,

а также отдельных чрезвычайных ситуаций, которые способны изменить сложившиеся тенденции, то это:

- a) стратегическое планирование;
- b) среднесрочное планирование;
- c) долгосрочное планирование;
- d) другой ответ.

14. Причиной предпринимательского риска является:

- a) предпринимательская деятельность;
- b) неопределенность;
- c) халатность;
- d) преднамеренность.

15. Риски по характеру последствий подразделяют на:

- a) чистые и спекулятивные;
- b) внешние и внутренние;
- c) систематические, несистематические;
- d) техногенные, природные и рыночные.

16. Управление рисками осуществляется в ходе проведения операций – это процессе, основанном на:

- a) активном подходе управления;
- b) адаптивном подходе управления;
- c) консервативном подходе управления.

17. Одним из принципов управления риском является:

- a) императивность управления;
- b) централизованный характер управления;
- c) идентификация отдельных видов рисков;
- d) экономичность управления.

18. Процесс распределения инвестируемых средств между объектами – это:

- a) хеджирование;
- b) кредитный портфель;
- c) диверсификация.

19. Стратегическое управление – это управление в социально-экономических системах, где выделяются функциональная, процессная и элементная стороны. Если «управление рассматривается как совокупность видов деятельности, направленных на достижение определённых результатов», то какая это сторона управления:

- a) функциональная;
- b) процессная;
- c) элементная;
- d) другая сторона.

20. Можно выделить четыре уровня знаний, составляющих методологию стратегического управления. Если рассматривается уровень «даёт понимание общих подходов, принципов, форм организации системы. Этот уровень образуют науки: теория систем, кибернетика, теория организаций и др.», то это уровень:

- а) конкретная методология наук;
 - б) методология, методика и технология стратегического управления;
 - с) общефилософский;
 - д) общенациональный.
21. Принципы стратегического менеджмента – это основные правила деятельности организации для достижения поставленных целей. Как называется данный принцип «нацелено на выполнение работы, большей по объёму и лучшей по качеству, при одних и тех же условиях»:
- а) разделение труда;
 - б) экономичность и эффективность;
 - с) единство направления;
 - д) выделение доминанты развития.
22. Как и любой процесс управления, стратегическое управление включает этапы: стратегический анализ; стратегический выбор (собственно планирование); реализация стратегии (реализация принятого решения). Стратегический анализ – это:
- а) высшее руководство отслеживает наиболее важные для будущего корпорации факторы, называемые стратегическими факторами;
 - б) формирование альтернативных направлений развития предприятия, их оценка, выбор лучшей стратегической альтернативы для реализации;
 - с) разработка программ, бюджетов и процедур, которые можно рассматривать как среднесрочные и краткосрочные планы реализации стратегии;
 - д) прогнозирование рыночной среды и разработка инструментов ее изменения под нужды организации.
23. Цели, разрабатываемые в рамках общих целей по основным видам деятельности в каждом производственном отделении фирмы и выражаются в количественных и качественных показателях – это:
- а) стратегические;
 - б) общие;
 - с) специфические;
 - д) перспективные.
24. Высший уровень стратегического менеджмента:
- а) деловой;
 - б) корпоративный;
 - с) функциональный;
 - д) оперативный.
25. Стратегическое планирование – это:
- а) построение «дерева целей» (иерархии целей) организации;
 - б) особый вид долгосрочных планов, позволяющих организации знать будущее;
 - с) выбор альтернативы развития;
 - д) определение перспективных направлений деятельности предприятия.

26. Пример ключевой цели организации – Завоевать лидерские позиции по вводу новых видов продукции (услуг), используя на исследования и разработки определенный процент доходов от объема реализации (продаж). К какой подсистеме относится данная цель:
- a) маркетинг;
 - b) научно-исследовательские разработки (инновации);
 - c) финансы;
 - d) менеджмент.
27. К методам планирования не относится:
- a) альтернативный;
 - b) нормативный;
 - c) научный;
 - d) экспериментальный.
28. Основная задача инновационной стратегии:
- a) обоснование для потенциальных инвесторов наиболее эффективных направлений вложения их капиталов;
 - b) выявление потенциального спроса и неудовлетворенных потребностей;
 - c) разработка и внедрение новой продукции;
 - d) выход на международные рынки с целью привлечения зарубежного капитала и поиска стратегических партнеров.
29. Стратегия – это:
- a) четко выраженная причина существования организации;
 - b) высокие слова, позволяющие организации формировать свой имидж;
 - c) набор решений и действий, помогающих организации достичь своих целей;
 - d) контроль внешних факторов для определения возможностей и угроз для организации.
30. При сравнении уровней рисков по отдельным инвестиционным проектам предпочтение при равных условиях следует отдавать тому из них, по которому значение коэффициента вариации самое...:
- a) большое;
 - b) среднее;
 - c) высокое;
 - d) низкое.
31. Кто ответственен за разработку и принятие миссии организации.
(Ответ: Собственники и высший управленческий персонал).
32. На ком или на чем фокусирует внимание миссия организации.
(Ответ: на цели деятельности).
33. Когда возникла наука «стратегическое управление» в обществе.
(Ответ: в 1960-1970 годы).
34. Каков временной горизонт при разработке среднесрочных целей компаний.
(Ответ: от года до пяти лет).

35. Как называется процесс проникновения организации в другие сферы производства.
(Ответ: диверсификация).
36. Какой метод управления рисками позволяет избежать потенциальных потерь, но не позволяет получить дополнительную прибыль.
(Ответ: уклонение от риска).
37. Какие показатели оценки рисков отличаются высокой степенью субъективизма и потому сложны в использовании для принятия решения.
(Ответ: качественные показатели).
38. Какой коэффициент применяется для оценки уровня риска, если показатели среднего ожидаемого дохода от осуществления операций различаются между собой.
(Ответ: коэффициент вариации).
39. Какие два критерия приведенных затрат для выбора оптимального метода воздействия на риск являются практически схожими.
(Ответ: Лапласа и Байеса).
40. Кто является автором метода построения цепочки ценностей.
(Ответ: М. Портер).

ПК-1. Способен принимать оптимальные стратегические решения в области управление рисками организаций.

ИПК-1.1. Проектирует системы управления рисками хозяйствующих субъектов

1. Основная задача производственной стратегии:
 - a) обоснование для потенциальных инвесторов наиболее эффективных направлений вложения их капиталов;
 - b) выявление потенциального спроса и неудовлетворенных потребностей;
 - c) развитие и модернизация производства;
 - d) выход на международные рынки с целью привлечения зарубежного капитала и поиска стратегических партнеров.
2. Стратегия, предполагающая развитие предприятия и превышение показателей каждого последующего года по сравнению с предыдущим:
 - a) стратегия роста;
 - b) стратегия сокращения;
 - c) стратегия фокусирования;
 - d) корпоративная стратегия.
3. Конкретные количественные измеряемые ориентиры, определяющие форму и время выполнения задания:
 - a) идеалы;
 - b) цели;

- c) задачи;
 - d) методы.
4. Цели, которые отражают соотношение темпа изменения объема продаж и прибыли организации, а также темпа изменения объема продаж и прибыли по отрасли в целом:
 - a) оперативные;
 - b) роста организации;
 - c) тактические;
 - d) сокращения.
 5. Планирование – это ...
 - a) предвидение будущего;
 - b) оперативное регулирование денежных потоков;
 - c) вид управленческой деятельности, связанный с составлением планов.
 6. Расчет движения денежных средств позволяет выявить:
 - a) дебиторов, которые систематически не платят за продукцию;
 - b) периоды, когда будет иметь место дефицит наличных средств;
 - c) уровень превышения постоянных издержек над переменными издержками.
 7. Среднесрочным целям соответствует плановый горизонт сроком в:
 - a) 5-10 лет;
 - b) 3-5 лет;
 - c) 1 год.
 8. Вертикальная интеграция:
 - a) увеличивает капитальные вложения в ту отрасль, где работает компания;
 - b) обеспечивает свободу выбора поставщиков;
 - c) позволяет использовать опыт фирмы в разных сферах бизнеса.
 9. Управление риском – это:
 - a) отказ от рискованного проекта;
 - b) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
 - c) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
 - d) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.
 10. Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:
 - a) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
 - b) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
 - c) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
 - d) умение ликвидировать такие последствия.
 11. Инновационный риск – это:

- a) риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований;
 - b) риск того, что новый товар не будет принят рынком;
 - c) риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен;
 - d) риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях.
12. Что из перечисленного не относится к видам производственных рисков?
- a) изменение конъюнктуры рынка;
 - b) усиление конкуренции;
 - c) форс-мажор;
 - d) амортизация производственного оборудования.
13. Коммерческий риск – это риск, возникающий:
- a) на коммерческих предприятиях;
 - b) при заключении коммерческих сделок;
 - c) в процессе реализации товаров или услуг;
 - d) в процессе производства товаров или услуг.
14. Волатильность – это:
- a) изменчивость рыночного спроса;
 - b) постоянство рыночного спроса;
 - c) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
 - d) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.
15. Валютный риск связан с:
- a) покупкой и продажей валют;
 - b) любыми потерями, обусловленными изменением курса иностранной валюты;
 - c) обменом одной иностранной валюты на другую;
 - d) ошибками при расчете кросс-курсов.
16. Инфляционный риск – это:
- a) риск увеличения темпов инфляции;
 - b) риск опережения роста доходов темпом их обесценивания;
 - c) риск инфляционных ожиданий;
 - d) риск возникновения разницы в темпах инфляции на разных рынках сбыта.
17. Системный риск – это:
- a) риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка;
 - b) риск разрушения системы управления организацией;
 - c) общая система рисков, которым подвергнута организация;
 - d) система оценки и управления рисками.
18. Деловой риск – это:
- a) риск неоплаты задолженности дебитором;
 - b) риск провала коммерческого проекта;
 - c) риск разрушения деловых отношений;
 - d) риск неисполнения обязательств по договору купли-продажи.

19. При наличии неопределенностей процесс выбора оптимальных решений:
- a) усложняется;
 - b) упрощается;
 - c) остается неизменным;
 - d) нет зависимости.
20. Какой прогнозируемостью характеризуется наступление события (P_t) при полной определенности?
- a) 0,3;
 - b) 0,7;
 - c) близкой к единице;
 - d) близкой к нулю.
21. Близкая к единице прогнозируемость событий соответствует:
- a) полной неопределенности;
 - b) полной определенности;
 - c) частичной неопределенности;
 - d) нет правильного ответа.
22. Неопределенность, связанную с отсутствием информации о вероятностях состояниях среды (природы), называют:
- a) сомнительной;
 - b) безнадежной;
 - c) неопределенной;
 - d) безвозвратной.
23. Чем рискованнее проект, тем норма его доходности должна быть:
- a) ниже;
 - b) выше;
 - c) норма доходности не зависит от риска;
 - d) нет правильного ответа.
24. Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:
- a) нулю;
 - b) единице;
 - c) 0,5;
 - d) 100.
25. В процессе принятия управленческих решений предпринимателю целесообразно различать и выделять определенные области (зоны риска) в зависимости от уровня возможных (ожидаемых) потерь. Для этого разработаны и используются:
- a) изометрические шкалы;
 - b) шкалы воздействия;
 - c) шкалы риска;
 - d) все ответы верны.
26. Вторая точка вероятности нежелательного исхода, соответствует:

- a) «нормальному», «разумному» риску, при котором рекомендуется принимать обычные предпринимательские решения;
 - b) вероятности нежелательного исхода;
 - c) потерям, равным имущественному состоянию предпринимателя;
 - d) нет правильного ответа.
27. Первая точка кривой рисков определяет:
- a) величину потерь, равных расчетной выручке;
 - b) вероятность нулевых потерь;
 - c) вероятности нежелательного исхода;
 - d) нет правильного ответа.
28. Финансирование под уступку денежного требования, подразумевающее передачу кредитного риска, это лежит в основе:
- a) биржевых сделок;
 - b) строительных контрактов;
 - c) контракта – поручительства;
 - d) договора факторинга.
29. Экспертный метод может быть реализован:
- a) путем обработки мнений опытных предпринимателей и специалистов;
 - b) с помощью опроса респондентов;
 - c) путем несистемной выборки;
 - d) нет правильного ответа.
30. Разновидностью экспертного метода является:
- a) метод Гаусса;
 - b) метод Иванова;
 - c) метод Дельфи;
 - d) все ответы верны.
31. Как называются методы управления рисками, предполагающие исключение рисковых ситуаций из бизнеса.
(Ответ: методы уклонения от риска).
32. Что собой представляют спекулятивные риски.
(Ответ: риски, которые могут принести дополнительную прибыль).
33. В чем заключается сущность концепции «риск-доходность».
(Ответ: чем выше риски, тем выше доходность, и наоборот).
34. От чего зависит величина финансового риска.
(Ответ: от величины и доли заемных средств в составе капитала).
35. Какой показатель служит основным при определении вероятности наступления рискового события.
(Ответ: коэффициент вариации).
36. Как называется система управления рисками в коммерческой организации.
(Ответ: система риск-менеджмента).
37. Организация выращивает овощи и реализует их на территории РФ. Организация планирует открыть мини-цех по переработке и консервированию овощей. Назовите вид стратегии развития.

(Ответ: стратегия диверсификации бизнеса).

38. Какой критерий оптимальной стратегии поведения обеспечивает минимальный ожидаемый размер приведенных издержек $A_L = \max_i \{\sum a_{ij} \times p_i\}$.

(Ответ: критерий Лапласа).

39. Какой метод используется для анализа внешней среды функционирования организации.

(Ответ: метод SWOT-анализа).

40. Какой основной внешний способ минимизации риска может использовать организация.

(Ответ: страхование).

ПК-2. Разрабатывает методическое обеспечение и осуществляет координацию процесса управления рисками.

ИПК-2.3. Оценивает эффективность воздействия на риск в избранной профессиональной сфере

1. Производственный риск высок там, где доля внеоборотных активов по сравнению с оборотными:
 - a) низка;
 - b) высока;
 - c) не имеет значения.
2. Возможность получения как положительного, так и отрицательного результата вытекает при наличии:
 - a) чистых рисков;
 - b) природных рисков;
 - c) спекулятивных рисков;
 - d) торговых рисков.
3. Источниками собственных средств финансирования инвестиционных проектов являются:
 - a) амортизационные отчисления;
 - b) прибыль;
 - c) основной капитал;
 - d) банковский кредит.
4. Высокий уровень операционного левереджа обеспечивает улучшение финансовых результатов от реализации при:
 - a) снижении продаж;
 - b) увеличении продаж;
 - c) неизменности продаж.
5. Распределение исследований и капиталовложений по разнонаправленным проектам – это:
 - a) лимитирование;
 - b) диверсификация;
 - c) страхование риска.

6. Процесс установления предельного размера заемного капитала – это:
 - а) лимитирование;
 - б) диверсификация;
 - в) страхование риска.
7. Обеспечение компенсации возможных потерь за счет системы штрафных санкций относится к:
 - а) системе финансирования рисков;
 - б) диверсификации;
 - в) внешним методам нейтрализации рисков;
 - д) прочим методам нейтрализации рисков.
8. Риск в хозяйственной деятельности может быть:
 - а) процесс выравнивания монетарным путем напряженности, возникшей в какой-либо социально-экономической среде;
 - б) нижний уровень доходности инвестиционных затрат;
 - в) вероятность возникновения условий, приводящих к негативным последствиям.
9. При консервативном подходе управления риском управляющие воздействия осуществляются:
 - а) после проведения предупреждающих мероприятий;
 - б) в ходе проведения хозяйственных операций;
 - в) после наступления рискового события;
 - д) не проводятся совсем.
10. Смешанное финансирование осуществляется путем привлечения финансовых средств, необходимых для реализации инновационных проектов:
 - а) из заемных и привлеченных источников;
 - б) различных источников;
 - в) собственных и заемных источников.
11. Привлеченный капитал фирмы включает следующие финансовые источники:
 - а) кредиты;
 - б) выпущенные векселя;
 - в) эмитированные облигации;
 - д) прибыль после уплаты налогов;
 - е) беспрецентное бюджетное финансирование.
12. Коммерческий банк не будет финансировать проект, если:
 - а) срок окупаемости проекта больше срока реализации проекта;
 - б) имеются источники возврата предоставляемых финансовых средств;
 - с) проект обеспечивает средний прирост инвестируемого капитала.
13. Для анализа финансовой устойчивости предприятия используют следующие показатели:
 - а) рентабельность продаж;
 - б) коэффициент текущей ликвидности;
 - в) коэффициент нормы прибыли;

д) коэффициент независимости.

14. Экономическая эффективность проекта означает:

- а) результат, получаемый в ходе вложения ресурсов (денежных, материальных, информационных, рабочей силы) в продукт или операцию (технологию), обладает определенным полезным эффектом (выгодой);
- б) результат, способствующий удовлетворению потребностей человека и общества;
- в) создание научно-технической продукции (прирост информации) в процессе научного труда.

15. Экономическая эффективность от управления рисками – это показатель:

- а) абсолютный;
- б) стоимостной;
- в) натуральный;
- г) относительный.

16. Показатель эффективности затратного типа представляет собой:

- а) отношение результата инноваций к величине совокупного живого и овеществленного труда (цена инноваций), которое было потреблено;
- б) отношение результата к величине примененных производственных ресурсов в стоимостном выражении.

17. Управление рисками осуществляется в ходе проведения операций – это процесс, основанный на:

- а) активном подходе управления;
- б) адаптивном подходе управления;
- в) консервативном подходе управления;
- г) агрессивном подходе управления.

18. Как изменится рентабельность собственного капитала организации, если экономическая рентабельность возрастет на 2% пункта, годовая средняя расчетная ставка процента по кредитам снизится на 1% пункт, соотношение заемного и собственного капитала составит 1:2:

- а) увеличится на 3% пункта;
- б) увеличится на 0,98% пункта;
- в) увеличится на 1,14% пункта;
- г) снизится на 3% пункта.

19. Предприятие выпускает два вида продукции. В полной себестоимости единицы продукции «А» на долю переменных затрат приходится 70%. В полной себестоимости единицы продукции «Б» на долю переменных затрат приходится 50%. Как изменится себестоимость единицы продукции «А» и «Б», если рост их производства составит 10%?

- а) величина снижения себестоимости единицы продукции в процентах будет одинаковой для продукции «А» и продукции «Б» и составит 10%;
- б) величина снижения себестоимости единицы продукции в процентах для продукции «А» будет выше, чем для продукции «Б»;

- с) величина снижения себестоимости единицы продукции в процентах для продукции «А» будет ниже, чем для продукции «Б».
20. Более высокую рентабельность из двух проектов имеет проект:
- проект, у которого инвестиции – 550 тыс. руб., предполагаемый доход – 660 тыс. руб.;
 - проект, у которого инвестиции – 1150 тыс. руб., предполагаемый доход – 1450 тыс. руб.
21. Дифференциал финансового левереджа должен быть величиной:
- относительной;
 - положительной;
 - нулевой;
 - отрицательной.
22. Рассчитайте индекс рентабельности проекта, если начальная инвестиция – 1000,0 тыс. руб.; доходы: в 1-й год – 450,0 тыс. руб.; 2-й год – 320,0 тыс. руб.; в 3-й год – 680 тыс. руб.; ставка процента – 16%:
- 1,45;
 - 1,25;
 - 0,77;
 - 1,061.
23. Каков NPV проекта, если инвестиции 4,5 млн. руб.; доходы по пяти годам ежегодно 2,5 млн. руб.; норма прибыли 30%:
- 6,09 млн. руб.;
 - 5,12 млн. руб.;
 - 3,37 млн. руб.;
 - 1,59 млн. руб.
24. Какой показатель выступает базисной характеристикой величины риска на рынке:
- ключевая ставка Центрального банка;
 - уровень инфляции;
 - ставка депозитного процента коммерческих банков;
 - норма прибыли крупных корпораций.
25. Если значение коэффициента вариации составляет от 10 до 25%, то отмечается:
- слабая колеблемость показателя риска;
 - умеренная колеблемость;
 - высокая колеблемость.
26. Каков будет чистый приведенный доход организации, если первоначальные вложения в бизнес составят – 8 млн. руб., а чистые поступления по годам составят: в первый год – 3 млн., во второй – 4 млн., в третий – 5 млн. руб., при ставке дисконтирования в 10%:
- 1,0 млн. руб.;
 - 4,0 млн. руб.;
 - 1,5 млн. руб.;
 - 1,8 млн. руб.

27. Какую сумму инвестору нужно положить на счет сегодня, чтобы затем в течение пяти лет ежегодно снимать 3000 руб., если ставка депозита – 10%:
- a) 11373 руб.;
 - b) 11893 руб.;
 - c) 10815 руб.;
 - d) 10299 руб.
28. Если участник рынка намерен более осторожно оценить некий финансовый актив с помощью DCF-модели, он должен:
- a) увеличить ставку дисконтирования;
 - b) пересмотреть безрисковую ставку;
 - c) снизить ставку дисконтирования;
 - d) элиминировать влияние риска.
29. Увеличение бета-коэффициента в динамике означает, что вложения в ценные бумаги данной компании становятся:
- a) более рисковыми;
 - b) более привлекательными для инвестирования;
 - c) нейтральными к риску;
 - d) менее рисковыми.
30. Определить, как изменился коэффициент оборачиваемости оборотного капитала, если выручка базисного года составила 120 млн. руб., отчетного года, 145 млн. руб., сумма оборотного капитала базисного года составила 38 млн. руб., отчетного - 44 тыс. руб.:
- a) увеличился на 14%;
 - b) увеличился на 4,3%;
 - c) снизился на 2%;
 - d) не изменился.
31. Какие инвестиции отличаются наиболее низкой ликвидностью.
(Ответ: реальные).
32. Какой динамический показатель оценки проектов обладает свойством аддитивности.
(Ответ: чистый приведенный доход).
33. Какой показатель всегда имеет более высокое значение – РР или DPP.
(Ответ: DPP).
34. Какой временной характер имеют затраты организации, связанные с осуществлением капитальных вложений.
(Ответ: долгосрочный).
35. Что является ценой заемного капитала в виде банковского кредита.
(Ответ: ставка ссудного процента)
36. Как называются рисковые фирмы, которые обычно создаются в областях предпринимательской деятельности, связанных с повышенной опасностью потерпеть убытки?
(Ответ: венчурные).

37. Какой макроэкономический показатель служит основным при расчете ставки дисконтирования.
(Ответ: уровень инфляции).
38. Внутренняя норма доходности инвестиционного проекта к каким показателям оценки относится.
(Ответ: динамическим).
39. Внеоборотные активы организации составляют 75 млн руб., на их финансирование потрачено 40% собственных ресурсов, заемные источники составляют 112,5 млн руб. Каков объем собственного капитала организации?
(Ответ: 300 млн. руб.).
40. Собственный капитал 35 млн руб., индекс постоянного актива – 0,8, оборотные активы – 30 млн руб. Определите коэффициент финансового левериджа:
(Ответ: 0,657).

4.2. Типовые задания для промежуточной аттестации

4.2.1. Вопросы к экзамену

Вопросы для оценки компетенции

УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий.

ИУК-1.4. Выстраивает сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения

Знать:

1. Теорию систем и сущность целеполагания.
2. Основы системного подхода как методологии системного анализа.
3. Сущность системного анализа как метода принятия и обоснования управленческих решений.
4. Информационную базу системного анализа деятельности.
5. Виды рисков в производственной и управленческой деятельности.

Уметь:

1. Осуществлять сбор информационных данных для проведения системного анализа деятельности организации.
2. Систематизировать и отбирать показатели для системного анализа деятельности организации.
3. Применять системный подход для решения управленческих задач.
4. Выполнить построение различных сценариев развития бизнес организации.
5. Идентифицировать возможные риски при реализации управленческих решений в хозяйственной деятельности.

Владеть:

1. Умением обобщать и систематизировать информационные данные для решения управленческих задач в деятельности организации.
2. Умением применять методы системного подхода в исследовании развития организаций.
3. Навыками выявления возможных рисков в развитии организации.
4. Навыками выбора направлений эффективного развития деятельности организаций.
5. Навыками экономического обоснования выбранного направления развития и путей его реализации.

Вопросы для оценки компетенции

ПК-1. Способен принимать оптимальные стратегические решения в области управления рисками организации.

ИПК-1.1. Проектирует системы управления рисками хозяйствующих субъектов

Знать:

1. Причины возникновения и принципы управления рисками в деятельности организации.
2. Закономерности развития рисковых ситуаций и возможные их последствия.
3. Методы анализа и оценки рисков.
4. Логику и последовательность разработки системы управления рисками в деятельности организации.
5. Способы проектирования системы управления рисками в деятельности.

Уметь:

1. Осуществлять сбор информации для проведения критического анализа проблемных ситуаций в деятельности организации.
2. Проанализировать конечные результаты вариантов решения управленческих задач.
3. Провести системный анализ результативных показателей при реализации управленческих решений.
4. Составить план управления рисками в деятельности организации.
5. Разработать и предложить систему риск-менеджмента в организации.

Владеть:

1. Умением обобщать и систематизировать информационные данные для критического анализа проблемных ситуаций в деятельности организации.
2. Умением применять методы анализа конечных результатов различных вариантов решения управленческих задач.
3. Навыками проведения системного анализа результативных показателей при реализации управленческих решений.
4. Навыками разработки и формирования плана управления рисками в деятельности организации.
5. Навыками экономической оценки обоснования системы риск-менеджмента в организации.

Вопросы для оценки компетенции

ПК-2. Разрабатывает методическое обеспечение и осуществляет координацию процесса управления рисками.

ИПК-2.3. Оценивает эффективность воздействия на риск в избранной профессиональной сфере

Знать:

1. Возможные направления и результаты управленческих решений в профессиональной сфере.
2. Показатели эффективности воздействия на риск бизнеса.
3. Методы расчета показателей эффективности управленческих решений.

4. Методы расчета возможных рисков при реализации управленческих решений в деятельности организации.
5. Показатели и методы оценки суммы потерь при возможных негативных последствиях реализации управленческих решений.

Уметь:

1. Осуществлять сбор информации для проведения анализа эффективности принятых решений.
2. Проанализировать финансовые последствия в профессиональной деятельности.
3. Проанализировать эффективность деятельности подразделений организации после реализации управленческих решений.
4. Дать характеристику возможным рискам в процессе реализации управленческих решений в профессиональной деятельности.
5. Оценить величину рисков управленческих решений.

Владеть:

1. Умением обобщать и систематизировать информационные данные для проведения анализа эффективности решений в профессиональной сфере.
2. Умением применять методы оценки эффективности воздействия на риск.
3. Навыками расчета показателей эффективности управленческих решений.
4. Умением рассчитать и дать количественную оценку величине возможных рисков при реализации управленческих решений в деятельности организации.
5. Навыками оценки потерь при возможных негативных последствиях реализации управленческих решений.

5. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ И НАВЫКОВ, И ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Критерии оценивания знаний обучающихся при проведении тестирования:

Результат тестирования оценивается по процентной шкале оценки. Каждому обучающемуся предлагается комплект тестовых заданий из 25 вопросов:

- **Отметка «отлично»** – 25-22 правильных ответов.
- **Отметка «хорошо»** – 21-18 правильных ответов.
- **Отметка «удовлетворительно»** – 17-13 правильных ответов.
- **Отметка «неудовлетворительно»** – менее 13 правильных ответов.

Критерии знаний при проведении экзамена:

• **Отметка «отлично»** – выполнены все виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. Обучающийся демонстрирует соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателям, оперирует приобретенными знаниями, умениями, навыками, применяет их в ситуациях повышенной сложности. При этом могут быть допущены неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.

• **Отметка «хорошо»** – выполнены все виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. Обучающийся демонстрирует соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателям, оперирует приобретенными знаниями, умениями, навыками, применяет их в стандартных ситуациях. При этом могут быть допущены незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.

• **Отметка «удовлетворительно»** – не выполнен один или более видов учебной работы, предусмотренных учебным планом. Обучающийся демонстрирует неполное соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателям, допускаются значительные ошибки, проявляется частичное отсутствие знаний, умений, навыков по ряду показателей, обучающийся испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

• **Отметка «неудовлетворительно»** – не выполнены виды учебной работы, предусмотренные учебным планом. демонстрирует неполное соответствие знаний, умений, навыков приведенным в таблицах показателей,

допускаются значительные ошибки, проявляется отсутствие знаний, умений, навыков по большему ряду показателей, обучающийся испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.

6. ДОСТУПНОСТЬ И КАЧЕСТВО ОБРАЗОВАНИЯ ДЛЯ ЛИЦ С ОВЗ

При необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья могут использоваться собственные технические средства.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:	– в печатной форме увеличенным шрифтом, – в форме электронного документа.
Для лиц с нарушениями слуха:	– в печатной форме, – в форме электронного документа.
Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата	– в печатной форме, аппарата: – в форме электронного документа.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине обеспечивает выполнение следующих дополнительных требований в зависимости от индивидуальных особенностей, обучающихся:

а) инструкция по порядку проведения процедуры оценивания предоставляется в доступной форме (устно, в письменной форме);

б) доступная форма предоставления заданий оценочных средств (в печатной форме, в печатной форме увеличенным шрифтом, в форме электронного документа, задания зачитываются преподавателем);

в) доступная форма предоставления ответов на задания (письменно на бумаге, набор ответов на компьютере, устно).

При необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.