

Контрольная работа № 3 по теме

«Аналитические подходы и процедуры оценки проектного риска»

Вариант 1

1. Некоторая возможная потеря, вызванная наступлением случайных неблагоприятных событий – это:
 - а) неопределенность;
 - б) случай;
 - в) риск;
 - г) все ответы верны.
2. Платой за риск выступают:
 - а) цена капитала;
 - б) рискованные премии;
 - в) норма дисконта;
 - г) оценка инвестиционных оттоков.
3. Какой из основных элементов риска отражает конкурентоспособность ближайшего окружения субъекта и объекта риска, – это элемент:
 - а) объект риска;
 - б) внешние факторы риска;
 - в) субъект риска;
 - г) внутренние факторы риска.
4. Выберите правильное определение (А-Г) к каждой категории:
 - а) объект риска;
 - б) субъект риска;
 - в) внешние факторы риска;
 - г) внутренние факторы риска.
- А. Экономические, политические, технические, информационные, социально-демографические, природно-климатические и другие факторы макросреды страны, региона или города, в котором находятся субъект и объект риска.
- Б. То, на что направлено воздействие хозяйствующего субъекта при принятии решения (инвестиции, проект, система и т.д.).
- В. Физическое или юридическое лицо, управляющее риском.
- Г. Конкурентоспособность ближайшего окружения субъекта и объекта риска (персонала, организационно-технического уровня производства, системы менеджмента и т.п.).
5. Риски, которые предполагают только перспективу потерь, – это:
 - а) инвестиционные риски;
 - б) политические риски;
 - в) чистые риски;
 - г) финансовые риски.
6. С целью снижения степени риска необходимо:
 - а) выбирать из альтернативных инвестиций наименее рискованный;
 - б) рассчитывать вероятность наступления риска;

- в) формировать источники финансирования только из собственных средств;
- г) нет правильного ответа.

Вариант 2

1. Инвестиционные риски относятся к рискам:
 - а) финансовым;
 - б) общим;
 - в) коммерческим;
 - г) производственным.
 2. При оценке проекта на первое место выходят риски, связанные с:
 - а) самим проектом;
 - б) фирмой-проектоустроителем;
 - в) фирмой-участником;
 - г) фирмой-кредитором.
 3. Какой из представленных ниже методов анализа риска носит описательный характер, а не аналитический:
 - а) статистический;
 - б) количественный;
 - в) качественный;
 - г) экспертный.
 4. Выберите правильное определение (А-Г) к каждой категории финансовых рисков, связанных с покупательной способностью денег:
 - а) дефляционный риск;
 - б) риск ликвидности;
 - в) инфляционный риск;
 - г) валютный риск.
 - А. Риск, связанный с возможностью потерь при реализации ценных бумаг.
 - Б. Риск, связанный с ростом инфляции.
 - В. Изменение курса одной иностранной валюты по отношению к другой.
 - Г. Риск, связанный с ростом дефляции
5. Систематический риск является:
 - а) не диверсифицируемым;
 - б) диверсифицируемым;
 - в) непредсказуемым;
 - г) неуправляемым.
 6. Одним из распространенных приемов сокращения степени риска является:
 - а) энтропия;
 - б) экстрополяция;
 - в) диверсификация;
 - г) форфейтинг.

Вариант 3

1. Реализация рискового события может привести к одному из трех экономических результатов. Выберите один неправильный вариант ответа:

- а) получение ущерба или убытка;
 - б) потеря фирмы-проектоустроителя;
 - в) отсутствие отклонений от поставленных целей или запланированных результатов;
 - г) получение дополнительной прибыли или выгоды.
2. К внутренним факторам риска можно отнести:
- а) ненадежность поставщиков;
 - б) плохая работа службы маркетинга организации;
 - в) стихийные бедствия;
 - г) применение организацией устаревшего оборудования в процессе осуществления инвестиционного проекта.
3. Риск неправильного выбора способа вложения капитала
- а) риск снижения доходности;
 - б) риск банкротства;
 - в) селективный риск;
 - г) риск упущенной выгоды.
4. В процессе исследования рисков используются как количественные, так и качественные методы анализа. Выберите правильную характеристику (А-Г) к каждому методу оценки риска:
- а) статистический метод;
 - б) метод аналогий;
 - в) метод экспертных оценок;
 - г) комбинированный метод.
- А. Предположение о наступлении неблагоприятного результата, которое основывается на индивидуальном суждении оценивающего (эксперта в данной области), на его личном опыте.
- Б. Устанавливается величина и частотность получения той или иной отдачи от инвестиций и составляется наиболее вероятный прогноз на будущее на основе определения дисперсии и среднего квадратического отклонения.
- В. Применение при оценке риска различных методов, дополняющих друг друга.
- Г. Применяется в основном при оценке рисков часто повторяющихся проектов, за основу анализа берется информационная база исследований ранее осуществленных схожих проектов
5. Какой из видов общего риска считается допустимым?
- а) потеря предполагаемой выручки;
 - б) угроза потери фирмой прибыли;
 - в) потеря всего имущества;
 - г) банкротство фирмы.
6. Распределение общей инвестиционной суммы между несколькими объектами инвестирования – это метод:
- а) покупка процентных опционов;
 - б) покупка валютных опционов;
 - в) заключение форвардных контрактов;
 - г) диверсификации.

