

Вариант 3

- 1) Безрисковая зона на шкале риска потери предприятием финансовой устойчивости характеризуется:
- а) абсолютной финансовой устойчивостью
 - б) недостатком собственных оборотных средств
 - в) недостатком собственных оборотных средств и излишком долгосрочных источников формирования запасов и затрат
 - г) $a + б$
 - д) $a + в$
- 2) Рассчитать возможную величину риска и доходность от инвестиционного проекта, если первоначальная величина по инвестициям составляет 2000 тыс.руб., сумма поступления по годам инвестиционного проекта составляет 400 тыс.руб., 500 тыс.руб., 700 тыс.руб., коэффициент дисконтирования на период составляет 11%
- а) 715
 - б) 714,7
 - в) 710,8
 - г) 716,7
- 3) Финансовое состояние предприятия оценивается
- а) Платежеспособностью и ликвидностью
 - б) Размером производства
 - в) Уровнем доходности
 - г) $б+в$
 - д) Ликвидностью активов
 - е) $a+д$
- 4) Наличие собственного оборотного капитала характеризует:
- а) доходность организации
 - б) минимальное условие для финансовой устойчивости
 - в) разность между собственным капиталом и внеоборотными активами
 - г) платежеспособность организации
- 5) При каком значении IRR инвестиционные проекты будут эффективны, если значение IRR:
- а) IRR больше стоимости капитала
 - б) IRR меньше стоимости капитала
 - в) равно 0
 - г) $a+б$
- 6) Финансовая устойчивость – это соотношение:
- а) Активов и обязательств
 - б) Оборотных активов и собственного капитала
 - в) Собственного и заемного капитала
 - г) $a+в$
 - д) $б+в$
- 7) Общая величина основных источников формирования запасов и затрат включает:
- а) сумма итога IV и V разделов бухгалтерского баланса
 - б) сумма III + IV + V раздела бухгалтерского баланса
 - в) сумма III+V раздела бухгалтерского баланса
- 8) Рассчитать чистый приведенный эффект (NVP), если первоначальные инвестиции составили 130 тыс.руб., накопленный доход через 2 года составил 200 тыс.руб. Ставка дисконтирования равна 10%
- а) 70 тыс.руб.
 - б) 58 тыс.руб.
 - в) 9 тыс.руб.
 - г) 37 тыс.руб.
- 9) Ликвидность активов – это
- а) Время обращения денежных средств
 - б) Скорость оборота оборотных активов
 - в) $a+б$
 - г) Время превращения активов в денежные средства

- 10) Каково оптимальное значение коэффициента риска при высоком риске на шкале оценки коэффициентов риска
- а) $K_p = 0,4$
 - б) $K_p = 0,3 : 0,6$
 - в) $K_p > 0,6$
 - г) $K_p < 1$
- 11) Рассчитать чистый приведенный эффект (NPV), если первоначальные инвестиции составили 100 тыс.руб., накопленный доход за 3 года составил 300 тыс.руб. Ставка дисконтирования равна 10%
- а) 75 тыс.руб.
 - б) 125 тыс.руб.
 - в) 120 тыс.руб.
 - г) 0
- 12) Источники экономической информации для оценки риска ликвидности:
- а) Отчет о движении денежных средств
 - б) Отчет об изменениях капитала
 - в) Бухгалтерский баланс
 - г) Отчет о финансовых результатах
- 13) Относительные показатели оценки риска:
- а) финансовые коэффициенты
 - б) специальные показатели, ориентированные на последствия рискованного события
 - в) индекс рыночной эффективности бизнес-операций
 - г) а+б
 - д) б+в
- 14) Рассчитать чистый приведенный эффект (NPV) и степень риска потери дохода, если первоначальные инвестиции составляют 300 тыс.руб., накопленный доход через 2 года – составляет 400 тыс.руб., ставка дисконтирования составляет 20%
- а) 26 тыс.руб.
 - б) 100 тыс.руб.
 - в) 78 тыс.руб.
 - г) 112 тыс.руб.
- 15) Модель Дюпона характеризует:
- а) Доходность капитала
 - б) Зависимость рентабельности собственного капитала от коэффициента финансовой зависимости
 - в) Рентабельности собственного капитала от рентабельности авансированного капитала
 - г) а+б
 - д) б+в
- 16) Результаты риска потери платежеспособности по абсолютным показателям ликвидности баланса характеризуют
- а) высокий уровень риска
 - б) зону критического риска
 - в) зону катастрофического риска
 - г) а+б
 - д) б+в
- 17) Рассчитать срок окупаемости инвестиционного проекта, если первоначальные инвестиции составили 1500 тыс.руб., а доход от инвестиций был равен в первый год – 700 тыс.руб., во 2 год – 600 тыс.руб., 3 год – 500 тыс.руб., 4 год - 900 тыс.руб.
- а) 1,7 года
 - б) 2 года
 - в) 3 года
 - г) 1,8 года
- 18) Модель Э. Альтмана устанавливает:
- а) уровень прибыли
 - б) доходность организации
 - в) возможность банкротства

- г) а+в
- д) б+в

19) Комплексная оценка риска проводится по показателям:

- а) относительным
- б) абсолютным
- в) относительным и абсолютным
- г) относительным показателям платежеспособности и структуры капитала

20) Рассчитать срок окупаемости инвестиционного проекта, если первоначальные инвестиции составили 700 тыс.руб., а полученный доход в первый год проекта составил 400 тыс.руб., во 2 год – 250 тыс.руб., в 3 год – 200 тыс.руб.

- а) 1 года
- б) 1,5 года
- в) 3 года
- г) 1,2 года