

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Кузнецова Эмилия Васильевна
Должность: Исполнительный директор
Дата подписания: 11.06.2025 15:22:18
Уникальный программный ключ:
01e176f1d70ae109e92d86b7d8f33ec82fbb87d6

ЧАСТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РЕГИОНАЛЬНЫЙ ИНСТИТУТ БИЗНЕСА И УПРАВЛЕНИЯ»

Рассмотрено и одобрено на заседании
Ученого совета
Протокол № 23/2 от 23 августа 2023 г.

УТВЕРЖЕНО
Проректор по учебно - воспитательной
работе и качеству образования

Ю.И.Паничкин
личная подпись инициалы, фамилия
«23» августа 2023 года

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по дисциплине «ПРОИЗВОДСТВЕННАЯ ПРАКТИКА (ПРЕДДИПЛОМНАЯ ПРАКТИКА)»

Направление подготовки / специальность 38.03.02 Менеджмент

Квалификация выпускника Бакалавр

Направленность (профиль) / специализация «Международный менеджмент»

Год начала подготовки - 2023

Для оценки сформированности компетенции:

ПК-2 «Способность анализировать, обосновывать и выбирать решения»

ИПК-2.1: Знает Способность анализировать и оценивать риски

ИПК-2.2: Умеет Способность анализировать и оценивать риски

ИПК-2.3: Владеет Способность анализировать и оценивать риски

Рязань 2023

Закрытые задания на установление соответствия

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и установите соответствие

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 1: Цикл риск менеджмента:

Этап	Описание
А) Идентификация	1) Сопоставление рассчитанного уровня риска с критериями приемлемости
Б) Анализ	2) Выявление потенциальных опасностей
В) Оценка/ранжирование	3) Расчёт вероятности и тяжести
Г) Обработка	4) Определение и внедрение мер защиты

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 3 мин.

Задание 2: Методы идентификации рисков:

Метод	Назначение
А) SWOT	1) Выявление исторических отказов в процессах
Б) Brainstorm	2) Генерация полного списка рисков командой
В) Контрольный список	3) Системное выявление типовых отраслевых угроз
Г) Анализ инцидентов	4) Классификация внешних угроз и возможностей

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 3: Финансовые коэффициенты:

Коэффициент	Отражаемый риск
А) Debt/Equity	1) Дефицит оборотных средств
Б) Interest Coverage	2) Риск дефолта по процентам
В) Current Ratio	3) Перекредитованность
Г) Cash Conversion Cycle	4) Риск кассового разрыва

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 3 мин.

Задание 4: Документы СУОТ:

Документ	Содержание
А) Политика ОТ	1) План внутренних проверок и аудитов
Б) Реестр профрисков	2) Цели и обязательства руководства
В) Программа обучения	3) Список рисков, оценки Р и S
Г) План аудитов	4) Тематика и периодичность инструктажей

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор ИПК-2.2

Время на ответ: 2 мин.

Задание 5: Heat map:

Зона	Интервал (пример)
А) Красная	1) $P \leq 0,3$ и $S \leq 3$
Б) Жёлтая	2) $0,3 < P < 0,7$ или $S = 3-4$
В) Зелёная	3) $P \geq 0,7$ и $S \geq 4$
Г) Серая	4) $P < 0,1$ и $S \leq 2$

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 3 мин.

Задание 6: Стратегии обработки:

Стратегия	Характеристика
А) Избежание	1) Передача риска страховщику
Б) Передача	2) Прекращение деятельности, порождающей риск
В) Снижение	3) Уменьшение вероятности или ущерба
Г) Принятие	4) Контроль остаточного риска без активных мер

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 7: Категории операционных рисков:

Категория	Пример
А) Процесс	1) Хищение средств сотрудником

Категория	Пример
Б) Персонал	2) Сбой ИТ-системы расчёта заработной платы
В) Система	3) Нарушение процедуры согласования платежа
Г) Внешняя среда	4) Наводнение и простой оборудования

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 8: Иерархия NIOSH:

Уровень	Пример
А) Устранение	1) СИЗ: наушники
Б) Замещение	2) Замена растворителя на водный
В) Инж. меры	3) Ограждение вращающихся частей
Г) СИЗ	4) Роботизация опасной операции

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 3 мин.

Задание 9: Зрелость RM:

Уровень	Описание
А) Initial	1) Формализованы процессы
Б) Managed	2) Процессы ad-hoc
В) Defined	3) KPI и интеграция
Г) Optimizing	4) Непрерывное улучшение

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 2 мин.

Задание 10: Инструменты процесс-анализа:

Инструмент	Назначение
А) SIPOC	1) Приоритетная карта рисков
Б) FMEA	2) Блок-схема «поставщик-вход-процесс-выход-клиент»
В) Heat map	3) RPN по операциям
Г) VSM	4) Поток создания ценности с таймингом и запасами

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 3 мин.

Задание 11: Количественный анализ:

Метод	Особенность
А) Монте-Карло	1) Однофакторная проверка чувствительности
Б) Анализ чувствительности	2) 10 000+ случайных итераций
В) Дерево решений	3) Сценарные ветви с NPV
Г) Байес-сеть	4) Условные вероятности взаимозависимых событий

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 2 мин.

Задание 12: HR риски:

Источник	Показатель
А) Текучесть	1) Age > 55 лет > 30 %
Б) Старение	2) Turnover > 15 %
В) Skills-gap	3) Gap index > 0,25
Г) Сопротивление	4) Участие в тренингах < 50 %

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 2 мин.

Задание 13: PESTEL:

Фактор	Риск
А) Political	1) Смена технологии у конкурента
Б) Economic	2) Повышение ставки ЦБ
В) Technological	3) Санкции / ограничения экспорта
Г) Legal	4) Ужесточение норм ОТ

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 3 мин.

Задание 14: Финансовые риски:

Вид	Ситуация

Вид	Ситуация
А) Валютный	1) Рост рублёвой цены сырья
Б) Процентный	2) Укрепление USD к RUB
В) Ценовой	3) Повышение LIBOR
Г) Ликвидности	4) Дефицит кэша

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 2 мин.

Задание 15:

Вопрос: КРІ ликвидности:

КРІ	Формула
А) Quick Ratio	1) $(CA - Inv)/CL$
Б) Current Ratio	2) $(Cash + AR)/CL$
В) Cash Runway	3) Cash/Burn p.m.
Г) NWC	4) $CA - CL$

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Индикатор: ОИПК-2.2

Время на ответ: 2 мин.

Задание 16: Структура отчёта

Раздел	Содержание
А) Цели	1) Итоговая оценка достижения
Б) Характеристика	2) Правовая форма, деятельность
В) Риск анализ	3) Карта рисков и меры
Г) Выводы	4) SMART-цели практики

Запишите выбранные буквы под соответствующими цифрами:

1	2	3	4

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Правильный вариант ответа
1	А → 2, Б → 3, В → 1, Г → 4
2	А → 4, Б → 2, В → 3, Г → 1
3	А → 3, Б → 2, В → 1, Г → 4
4	А → 2, Б → 3, В → 4, Г → 1
5	А → 3, Б → 2, В → 1, Г → 4
6	А → 2, Б → 1, В → 3, Г → 4

7	$A \rightarrow 3, B \rightarrow 1, V \rightarrow 2, G \rightarrow 4$
8	$A \rightarrow 4, B \rightarrow 2, V \rightarrow 3, G \rightarrow 1$
9	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 3, V \rightarrow 1, G \rightarrow 4$
10	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 3, V \rightarrow 1, G \rightarrow 4$
11	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 1, V \rightarrow 3, G \rightarrow 4$
12	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 1, V \rightarrow 3, G \rightarrow 4$
13	$A \rightarrow 3, B \rightarrow 2, V \rightarrow 1, G \rightarrow 4$
14	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 3, V \rightarrow 1, G \rightarrow 4$
15	$A \rightarrow 2, B \rightarrow 1, V \rightarrow 3, G \rightarrow 4$
16	$A \rightarrow 4, B \rightarrow 2, V \rightarrow 3, G \rightarrow 1$

Закрытые задания на установление последовательности

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и установите последовательность

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 1: Определите правильную последовательность формирования плана:

- А) Определение целей
- Б) Выявление рисков
- В) Разработка мер
- Г) Утверждение плана

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 2: Определите порядок действий для минимизации риска потери документов:

- А) Проверка комплекта
- Б) Регистрация
- В) Изучение правил хранения
- Г) Создание электронной копии

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 3: Установите последовательность сбора базовой информации:

- А) Учредительные документы
- Б) Публичные источники
- В) Интервью
- Г) Паспорт-досье

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 4: Определите порядок:

- А) Форма собственности
- Б) Лицензии
- В) Соответствие уставу
- Г) Сверка адреса

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 5: Анализ оргструктуры:

- А) Схема оргструктуры
- Б) Дубли функций
- В) Критичность узлов
- Г) Рекомендации

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 6: Картирование бизнес-процессов:

- А) SIPOC
- Б) ККТ
- В) Оценка S/O
- Г) Heat-map

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 7: Анализ КРІ:

- А) Сбор отчётов
- Б) Индексация
- В) Тренды
- Г) Влияние на риск

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 8: HR риски:

- А) Текучесть
- Б) Сегментация знаний

В) Вероят-ть/ущерб

Г) Удержание

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 9: Кадровая статистика:

А) База должностей

Б) Коэффициенты

В) Бенчмарк

Г) Кадровые риски

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 10: Киберриски ИТ-системы:

А) Инвентаризация

Б) Уязвимости

В) Матрица P×S

Г) План защит

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 11: Риски коммуникаций:

А) Карта каналов

Б) SPOF

В) Вероят-ть отказа

Г) Резервирование

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 12: Рыночные риски:

А) Доля рынка

Б) 5 сил Портера

В) Ценовая эластичность

Г) Карта угроз

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 13: PESTEL-факторы:

- А) Сбор данных
- Б) Классификация
- В) Оценка влияния
- Г) Приоритеты

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 14: Структура отчёта:

- А) Цели
- Б) Описание предприятия
- В) Риск-анализ
- Г) Выводы

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 5 мин.

Задание 15: Подготовка защиты:

- А) Презентация
- Б) Тайминг
- В) Оборудование
- Г) Ответы на вопросы

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 16: Самооценка ПК-2:

- А) Сравнить результаты с целями
- Б) Рефлексия в дневнике
- В) Зоны роста
- Г) План развития

Запишите соответствующую последовательность букв с лева на право:

--	--	--	--

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Правильный вариант ответа
1	А → Б → В → Г
2	А → Б → В → Г
3	Б → А → В → Г
4	А → Г → В → Б
5	А → Б → В → Г
6	А → Б → В → Г
7	А → Б → В → Г

8	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
9	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
10	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
11	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
12	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
13	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
14	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
15	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$
16	$A \rightarrow B \rightarrow V \rightarrow \Gamma$

Открытые задания с развернутым ответом

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 1: Что такое *остаточный риск (residual risk)*?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: Как сокращение Cash Conversion Cycle уменьшает риск ликвидности?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 3: В чём разница между *аппетитом к риску* и *толерантностью к риску*?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: Какие четыре основные категории *операционных рисков* выделяет

Базель II?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 5: Почему высокий Debt/Equity увеличивает финансовый риск компании?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 6: Что произойдёт с валовой маржой, если цены на сырьё вырастут на 20 %, а цена продажи неизменна?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 7: Считаете ли вы страхование эффективным методом передачи риска?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 8: Какой единый инструмент вы бы выбрали для хеджирования валютного риска импортёра и почему?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 9: У компании $ССС = 120$ дней. Назовите главный риск и предложите базовое решение.

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 10: Что такое *RTO* в плане непрерывности бизнеса?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 11: Как производственный буфер влияет на риск простоя линии?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 12: Чем отличается стресс-тест от сценарного анализа?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 13: Перечислите ступени иерархии мер безопасности NIOSH сверху вниз.

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 14: Почему несвоевременное ТО узкого места повышает риск «бутылочного горлышка»?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 15: Что произойдёт с кредитным рейтингом, если Interest Coverage Ratio упадёт ниже 1?

Поле для ответа:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 5 мин.

Задание 16: Какой один финансовый коэффициент вы бы выбрали для раннего обнаружения банкротства и почему?

Поле для ответа:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ (развернутое обоснование)
1	Риск, остающийся после всех мер контроля.
2	Ускоряет оборот кэша и снижает потребность во внешнем финансировании.
3	Аппетит — целевой уровень, толерантность — допустимый диапазон отклонений
4	Процесс-, персонал-, система- и внешнесредовые риски
5	Повышает обязательные процентные платежи и вероятность дефолта при падении прибыли.
6	Маржа снизится
7	Да, если премия меньше ожидаемого убытка и риск измерим.
8	Валютный форвард — фиксирует курс без премии
9	Риск кассового разрыва; сократить DSO, например факторингом
10	Максимально допустимое время восстановления процесса после сбоя.
11	Снижает риск, обеспечивая задел при кратком сбое upstream-операции.
12	Стресс-тест моделирует экстремум, сценарный — вероятные варианты развития.

13	Устранение, замещение, инженерные, административные, СИЗ.
14	Уменьшает доступность оборудования, создавая простой и очередь WIP
15	Рейтинг снизится.
16	Cash flow / Total Debt — показывает реальную способность обслуживать долг.

Закрытые задания с выбором одного правильного ответа

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст, выберите правильный ответ и запишите в поле для ответа

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 1: Какой первый шаг предусматривает стандарт ISO 31000 при организации процесса управления рисками?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Разработка мер реагирования
- Б) Идентификация рисков
- В) Мониторинг и пересмотр
- Г) Оценка вероятности риска

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 2: Какой документ СУОТ фиксирует **оценку вероятности и тяжести** профессиональных рисков?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Политика в области охраны труда
- Б) Реестр профессиональных рисков
- В) План-график внутренних аудитов
- Г) Программа обучения персонала

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 3: Какой показатель первым сигнализирует о росте **риска дефолта по процентным платежам?**

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) EBITDA-margin
- Б) Interest Coverage Ratio
- В) Quick Ratio
- Г) Debt/Equity

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 4: К какой зоне тепловой карты относится риск с вероятностью 0,2 и ущербом 5 (по шкале 1–5), если пороги зон заданы как:

- Красная — $P \geq 0,3$ и $S \geq 4$
- Жёлтая — $P < 0,3$ и $S \geq 4$
- Зелёная — остальные?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Красная
- Б) Жёлтая
- В) Зелёная
- Г) Серая

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 5: Какой показатель лучше всего отражает **риск утраты критических знаний?**

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Коэффициент текучести персонала
- Б) Средний возраст сотрудников
- В) Доля сотрудников старше 55 лет в ключевых должностях
- Г) Среднее количество дней больничного на человека

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 6: На каком этапе анализа маршрутного листа **впервые** присваивается приоритет числу риска (RPN)?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Построение SIPOC
- Б) Выделение критических операций
- В) Назначение точек контроля
- Г) Оценка надёжности оборудования

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 7: Какой из перечисленных протоколов SCADA-сетей наиболее уязвим к атаке «man-in-the-middle» из-за отсутствия аутентификации и шифрования?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) OPC UA (с TLS)
- Б) MQTT 5.0
- В) Modbus/TCP
- Г) HTTPS

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 8: Какой фактор PESTEL относится к группе **Technological**?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Повышение ключевой ставки ЦБ
- Б) Появление блокчейн-технологий в отрасли
- В) Введение экспортных пошлин
- Г) Изменение трудового законодательства

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 5 мин.

Задание 9: Какой уровень CMMI-RM характеризуется стандартизированными процедурами, но ещё без оптимизации на основе аналитики?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Initial
- Б) Managed
- В) Defined
- Г) Optimizing

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 10: Какой дериватив **не требует** уплаты премии при заключении и фиксирует курс для обеих сторон?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Валютный опцион
- Б) Валютный форвард
- В) Валютный своп-нон-деливери
- Г) Биржевой futures-контракт

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 11: Какой элемент сети является **Single Point of Failure (SPOF)**?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Резервируемый интернет-канал
- Б) Единственный контроллер домена без реплики
- В) Кольцевая топология с дублирующими свичами
- Г) Балансировщик с режимом Active-Active

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 12: Какой показатель показывает, на сколько месяцев хватит денежных средств при текущем отрицательном cash-flow?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- A) Quick Ratio
- B) Current Ratio
- B) Cash Runway (Burn Rate)
- Г) Net Working Capital

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 4 мин.

Задание 13: Какой финансовый инструмент чаще всего используют для хеджирования процентного риска по плавающей ставке?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- A) FRA (Forward Rate Agreement)
- B) Валютный форвард
- B) Коммодити-своп
- Г) Опцион «колл» на нефть

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 5 мин.

Задание 14: Рост цен на основной вид сырья относится к какому виду риска?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- A) Валютному
- B) Ценовому (коммодитиз)
- B) Процентному
- Г) Ликвидности

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 4 мин.

Задание 15: Какой показатель проекта чаще всего варьируется первым при анализе чувствительности NPV?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- A) Ставка дисконтирования
- B) Объем продаж
- B) Остаточная стоимость
- Г) Налоговая ставка

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 4 мин.

Задание 16: Какой риск презентации **чаще всего** приводит к снижению оценки на защите отчёта?

✓ **Выберите один правильный ответ:**

- А) Недостаточное количество слайдов
- Б) Превышение регламентного времени
- В) Использование корпоративного стиля
- Г) Наличие графиков вместо таблиц

Ответ:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ	Ответ (развернутое обоснование)
1	Б	Без перечня угроз невозможно анализировать или управлять рисками.
2	Б	Именно реестр содержит таблицу рисков с полями «Р» и «S».
3	Б	ICR напрямую сравнивает прибыль с обязательными процентами.
4	Б	Ущерб высокий (≥ 4), но вероятность $< 0,3 \rightarrow$ жёлтая.
5	В	Комбинирует признак возраста и критичности позиции.
6	Б	RPN считается именно для критичных операций.
7	В	Передаёт команды в «чистом виде» без криптографической защиты.
8	Б	Речь идёт о новой технологии, а не о законе или экономике.
9	В	Defined — стандарты и регламенты; оптимизация начинается на Optimizing.
10	Б	Форвард – контракт без премии, обязательный для обеих сторон.
11	Б	Отказ единственного DC остановит всю авторизацию.
12	В	Runway = Cash / Monthly Burn, измеряется в месяцах.
13	А	FRA фиксирует будущую процентную ставку.
14	Б	Изменение цены товара — ценовой (commodity) риск.
15	Б	Выручка – главный драйвер денежного потока.
16	Б	Перебор времени прерывает выступающего и сокращает блок вопросов.

Закрытые задания с выбором нескольких вариантов ответа

Инструкция для выполнения задания: прочитайте текст, выберите все правильные ответы и запишите в поле для ответов

Профессиональная компетенция ПК-2

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 7 мин.

Задание 1: Выберите все верные действия, снижающие риск кассового разрыва:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Сокращение DSO (Days Sales Outstanding)
- 2) Увеличение DPO (Days Payables Outstanding)
- 3) Рост товарных запасов на 30 %
- 4) Использование овердрафт-линии банка
- 5) Выплата дивидендов из нераспределённой прибыли

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 7 мин.

Задание 2: Выберите все верные инструменты хеджирования экспортёра:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Валютный форвард
- 2) Кэп-опцион (процентный)
- 3) Валютный фьючерс
- 4) Открытая валютная позиция
- 5) Внутригрупповой back-to-back своп

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 8 мин.

Задание 3: Выберите все верные показатели риска потери критических знаний:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Коэффициент текучести > 15 % в год
- 2) Engagement Index < 60 %
- 3) Доля сотрудников 55+ в ключевых ролях > 30 %
- 4) Средний больничный > 7 дней/сотр./год
- 5) Обучение > 80 часов на сотрудника

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 7 мин.

Задание 4: Выберите все неверные причины образования узкого места:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Несвоевременное техническое обслуживание критического оборудования
- 2) Избыточный буфер WIP перед узлом
- 3) Разная тактовка смежных операций
- 4) Ограниченная пропускная способность склада готовой продукции
- 5) Сокращение времени переналадки (SMED)

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 7 мин.

Задание 5: Выберите все верные методы оценки VaR портфеля:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Монте-Карло-симуляция
- 2) Историческое моделирование
- 3) Анализ чувствительности « Δ -1 фактор»
- 4) Параметрический (корень из t)
- 5) χ^2 -тест критических значений

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 7 мин.

Задание 6: Выберите все ситуации, относящиеся к ценовому (commodity) риску:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Колебание котировок нефти
- 2) Укрепление курса USD/RUB
- 3) Рост цен на сталь
- 4) Повышение ставки MosPrime
- 5) Подорожание природного газа

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 8 мин.

Задание 7: Выберите все меры инженерного уровня:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Локальная вытяжная вентиляция
- 2) Замена растворителя на водный
- 3) Ограждение вращающихся валов
- 4) Инструктаж по ТБ
- 5) Респиратор FFP3

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 7 мин.

Задание 8: Выберите несколько неверных методов первичной идентификации рисков:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Диаграмма Исикавы
- 2) Brainstorm

- 3) Контрольный чек-лист
- 4) Анализ чувствительности
- 5) SWOT-анализ

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 8 мин.

Задание 9: Выберите все верные ИОС текущей атаки на SCADA-сеть:

✓ **Выберите несколько правильных ответов:**

- 1) Появление неизвестных admin-учёток
- 2) Плановый бэкап данных
- 3) Исходящий трафик к неавторизованным IP-адресам
- 4) Обнуление тревог системы безопасности
- 5) Несанкционированное изменение конфигурации PLC

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 7 мин.

Задание 10: Выберите все признаки уровня Managed:

✓ **Выберите несколько правильных ответов:**

- 1) Регулярный сбор KPI риска
- 2) Процессы ad-hoc, реактивные
- 3) Формализованные стандарты и процедуры
- 4) Интеграция RM в стратегию
- 5) Дашборды онлайн-мониторинга

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 11: Выберите все верные метрики плана непрерывности бизнеса:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) RTO
- 2) NPV проекта
- 3) RPO
- 4) SLA с клиентом
- 5) EBITDA-margin

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 7 мин.

Задание 12: Выберите все верные профилактические меры:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Внедрение LOTO-процедуры

- 2) Сокращение инструктажей
- 3) Периодические медосмотры
- 4) Отмена СИЗ в низкорисковых зонах
- 5) Инженерное ограждение конвейера

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.1

Время на ответ: 7 мин.

Задание 13: Выберите все факторы группы Economic:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Инфляция 10 %
- 2) Новые экологические нормы
- 3) Девальвация национальной валюты
- 4) Достижения квантовых вычислений
- 5) Рост безработицы до 8 %

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 14: Выберите несколько неверных инструментов снижения процентного риска:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) IRS (процентный своп)
- 2) Кэп-опцион
- 3) Commodity swap
- 4) FRA (Forward Rate Agreement)
- 5) Базель III коэффициент LCR

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.3

Время на ответ: 7 мин.

Задание 15: Выберите все верные цели анализа чувствительности:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Выявить ключевые драйверы NPV
- 2) Оценить интегральную вероятность банкротства
- 3) Проверить устойчивость NPV к изменению одного фактора
- 4) Найти переменные с минимальным влиянием
- 5) Смоделировать совместное изменение всех факторов

Ответ:

Индикатор: ИПК-2.2

Время на ответ: 8 мин.

Задание 16: Выберите все верные меры:

✓ **Выберите несколько неправильных ответов:**

- 1) Репетиция тайминга выступления
- 2) Распечатка слайдов для членов комиссии
- 3) Игнорирование возможных вопросов
- 4) Проверка оборудования за сутки до защиты
- 5) Соккрытие негативных выводов отчёта

Ответ:

Ключи к заданиям

Номер вопроса	Ответ	Ответ (развернутое обоснование)
1	1, 2, 4	Ускоряем поступления, откладываем платежи, держим кредитную «подушку».
2	1, 3, 5	Форвард, фьючерс и внутренний своп фиксируют курс, уменьшая FX риск.
3	1, 2, 3	Высокая текучесть, низкая вовлечённость и старение ключевого ядра указывают на грядущий отток знаний.
4	2, 5	Буфер и SMED, наоборот, снижают вероятность горлышка.
5	1, 2, 4	Утверждённые Базелем способы: Monte Carlo, historical, parametric.
6	1, 3, 5	Изменение цены товара (не валюты, не ставки) — commodity риск.
7	1, 3	Инженерные меры — физический барьер или техсредство.
8	1, 4	Исикава и чувствительность служат для анализа причин/влияния, а не для первичного списка.
9	1, 3, 5	Новые admin аккаунты, подозрительный трафик и изменение PLC — классические признаки взлома.
10	1,5	Managed — мониторинг и KPI; стандарты — следующий уровень, интеграция — ещё выше.
11	1, 3, 4	RTO, RPO и SLA — прямые параметры BCP.
12	1, 3, 5	ЛОТО, медосмотры, ограждения — прямое снижение риска; 2 4 – его повышение.
13	1, 3, 5	Инфляция, курс и безработица – макроэкономика.
14	3, 5	Коммодити своп и LCR не связаны напрямую с процентной ставкой.
15	1, 3, 4	Чувствительность — one factor at a time: ищем драйверы и «невлиятельные» переменные.
16	1, 2, 4	Репетиция, бумажный backup и проверка техники минимизируют срывы; игнор вопросов и сокрытие фактов увеличивают риск.