

**Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»
(Финансовый университет)**

Уральский филиал Финуниверситета

Кафедра «Экономика, финансы и управление»

СОГЛАСОВАНО

Администрация Калининского
района г. Челябинска
Заместитель Главы

И.Г. Матвеева
«___» марта 2021 г.

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала

 И.А. Кравченко

20 февраля 2024 г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по дисциплине

Риск-менеджмент

Направление подготовки 38.03.02 - Менеджмент
образовательная программа – Управление бизнесом
профиль – Менеджмент и управление бизнесом
(наименование направленности (профиля) образовательной программы)

Разработан в соответствии с рабочей программой «Риск-менеджмент», одобренной кафедрой
«Экономика, финансы и управление» (протокол № 06 от «30» января 2024 г.)

Челябинск, 2024

Название дисциплины:

Риск-менеджмент

Планируемые результаты освоения дисциплины

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ПКП-1	Способность планировать, организовывать и контролировать командную работу, вести деловые переговоры и реагировать на изменения (ПКП - 1)	1. Демонстрирует владение методами планирования, организации и контроля командной работы 2. Применяет современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций
ПКП-5	Способность оценивать риски и разрабатывать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций (ПКП - 5)	1. Демонстрирует навыки по оценке рисков и мониторинга деятельности компании 2. Разрабатывает программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций.

Оценочные средства

Номер задания	Содержание оценочных материалов	Правильный ответ	Компетенция(и)
1.	Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей? 1. вероятностный метод 2. построение дерева решений 3. метод сценариев 4. анализ чувствительности 5. учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости	1 - вероятностный метод	ПКП-1, ПКП-5
2.	Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта? 1. построение дерева решений 2. метод сценариев 3. учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости 4. вероятностный метод 5. +анализ чувствительности 6. имитационное моделирование	5. анализ чувствительности	ПКП-1, ПКП-5
3.	Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск	3 учет рисков при расчете чистой	ПКП-1, ПКП-5

	или путем учета вероятности возникновения денежных потоков? <ol style="list-style-type: none"> 1. построение дерева решений 2. метод сценариев 3. +учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости 4. анализ чувствительности 5. вероятностный метод имитационное моделирование	приведенной стоимости	
4.	Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий? <ol style="list-style-type: none"> 1. имитационное моделирование 2. вероятностный метод 3. учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости 4. +построение дерева решений 5. анализ чувствительности метод сценариев	4 построение дерева решений	ПКП-1, ПКП-5
5.	Какой из перечисленных методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты? <ol style="list-style-type: none"> 1. учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости 2. анализ чувствительности 3. построение дерева решений 4. вероятностный метод 5. метод сценариев 6. +имитационное моделирование 	6 имитационное моделирование	ПКП-1, ПКП-5
6.	Каким образом при расчете чистой приведенной стоимости можно учитывать риск? <ol style="list-style-type: none"> 1. в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта 2. комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков 3. +все варианты верны 4. в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков 	3 все варианты верны	ПКП-1, ПКП-5

7.	<p>Что является субъектом управления в риск-менеджменте?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками 2. все варианты верны 3. риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами 	1 специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками	ПКП-1, ПКП-5
8.	<p>Что является объектом управления в риск-менеджменте?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами 2. все варианты верны 3. специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками 	1 риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами	ПКП-1, ПКП-5
9.	<p>Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл...</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +закона неизбежности риска 2. закона сочетания потенциальных потерь и выгод 3. закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов 	1 закона неизбежности риска	ПКП-1, ПКП-5
10.	<p>Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл...</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов 2. закона неизбежности риска 3. +закона сочетания потенциальных потерь и выгод 	3 закона сочетания потенциальных потерь и выгод	ПКП-1, ПКП-5
11.	<p>Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл...</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых 	1 закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых	ПКП-1, ПКП-5

	<p>доходов</p> <ol style="list-style-type: none"> 2. закона неизбежности риска 3. закона сочетания потенциальных потерь и выгод 	доходов	
12.	<p>12 К какой группе методов управления рисками относится прогнозирование внешней обстановки?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +методы компенсации рисков 2. методы уклонения от рисков 3. методы локализации рисков 4. методы диверсификации рисков 	1 методы компенсации рисков	ПКП-1, ПКП-5
13.	<p>К какой группе методов управления рисками относится страхование?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. +методы уклонения от рисков 2. методы диверсификации рисков 3. методы локализации рисков 4. методы компенсации рисков 	1 методы уклонения от рисков	ПКП-1, ПКП-5
14.	<p>К какой группе методов управления рисками относится распределение риска по этапам работы?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. методы локализации рисков 2. методы компенсации рисков 3. методы уклонения от рисков 4. +методы диверсификации рисков 	4 методы диверсификации и рисков	ПКП-1, ПКП-5
15.	<p>К какой группе методов управления рисками относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. методы диверсификации рисков 2. методы уклонения от рисков 3. методы компенсации рисков 4. +методы локализации рисков 		ПКП-1, ПКП-5
16.	<p>К какой группе методов управления рисками относится обучение и инструктирование персонала?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. методы уклонения от рисков 2. +методы компенсации рисков 3. методы диверсификации рисков 4. методы локализации рисков 	4 методы локализации рисков	ПКП-1, ПКП-5
17.	<p>К какой группе методов управления рисками относится распределение ответственности между участниками проекта?</p>	1 методы диверсификации и рисков	ПКП-1, ПКП-5

	1. +методы диверсификации рисков 2. методы компенсации рисков 3. методы локализации рисков 4. методы уклонения от рисков		
18.	К какой группе методов управления рисками относится увольнение некомпетентных сотрудников? 1. методы локализации рисков 2. методы диверсификации рисков 3. +методы уклонения от рисков 4. методы компенсации рисков	3 методы уклонения от рисков	ПКП-1, ПКП-5
19.	К какой группе методов управления рисками относится создание системы резервов? 1. методы уклонения от рисков 2. методы диверсификации рисков 3. +методы компенсации рисков 4. методы локализации рисков	3 методы компенсации рисков	ПКП-1, ПКП-5
20.	К какой группе методов управления рисками относится создание специальных инновационных подразделений? 1. +методы локализации рисков 2. методы диверсификации рисков 3. методы компенсации рисков 4. методы уклонения от рисков	1 методы локализации рисков	ПКП-1, ПКП-5
21.	К какой группе методов управления рисками относится распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности? 1. +методы диверсификации рисков 2. методы локализации рисков 3. методы компенсации рисков 4. методы уклонения от рисков	1 методы диверсификации и рисков	ПКП-1, ПКП-5

Критерий оценки знаний

Критерий	Оценка	Процент выполненных заданий
Глубокое усвоение программного материала (высокий уровень сформированности компетенций), логически стройное его изложение, умение связать теорию с практикой, свободное решение задач и обоснование принятого решения, выполнение текущей работы	Отлично	86-100
Твердые знания программного материала (продвинутый уровень сформированности)	Хорошо	70-85

компетенций), грамотное и по существу его изложение, допустимы не существенные неточности в ответе на вопрос, правильное применение теоретических положений при решении практических вопросов и задач, выполнение текущей работы		
Знание только основного материала (пороговый уровень сформированности компетенций), допустимы неточности в ответе на вопрос, недостаточно правильные формулировки, нарушение логической последовательности в изложении программного материала, затруднения при решении практических задач, выполнение текущей работы в семестре	Удовлетворительно	51-69
Незнание значительной части программного материала (не сформирован пороговый уровень компетенций), неумение даже с помощью преподавателя сформулировать правильные ответы на вопросы экзаменационного билета, невыполнение практических заданий	Неудовлетворительно	0-50