

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ

Кафедра Учета и финансовых технологий

Рег. № ЭК. 03-50
« 05 » 10 20 22 г.

УТВЕРЖДЕН

Протокол от « 12 » 09 2022 г. № 2

Заведующий кафедрой

О.С. Шинделова
(подпись) О.С. Шинделова

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Б1.В.21 Риск-менеджмент

38.03.01 Экономика

профиль: **Экономика**

основной вид деятельности: **аналитическая, научно-исследовательская**

дополнительный вид деятельности **организационно-управленческая, расчётно-экономическая**

**Паспорт
фонда оценочных средств**

№ п/п	Контролируемые разделы дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1.	Тема 1. Риск- как экономическая категория	ПК-3 ПК-11	собеседование
2.	Тема 2. Виды и классификация рисков	ПК-3 ПК-11	собеседование
3.	Тема 3. Организация риск-менеджмента на предприятии.	ПК-3 ПК-11	собеседование
4.	Тема 4. Технология анализа и оценки рисков предприятия	ПК-3 ПК-11	собеседование
5.	Тема 5. Управление рисками в системе риск-менеджмента	ПК-3 ПК-11	собеседование
6.	Тема 6. Основы антикризисного управления	ПК-3 ПК-11	собеседование
7.	Тема 7. Риск-менеджмент в особых категориях проектного управления	ПК-3 ПК-11	собеседование

МАТРИЦА СООТВЕТСТВИЯ КРИТЕРИЕВ ОЦЕНКИ УРОВНЮ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ

Критерии оценки	Уровень сформированности компетенций
Оценка по пятибалльной системе	
«Отлично»	«Высокий уровень»
«Хорошо»	«Повышенный уровень»
«Удовлетворительно»	«Пороговый уровень»
«Неудовлетворительно»	«Не достаточный»
Оценка по системе «зачет – незачет»	
«Зачтено»	«Достаточный»
«Не зачтено»	«Не достаточный»

Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

1. Положение «О балльно-рейтинговой системе аттестации студентов»: СМК ПНД 08-01-2022, введено приказом от 28.09.2011 №371-О (<http://nsau.edu.ru/file/403>: режим доступа свободный);

2. Положение «О проведении текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся в ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ»: СМК ПНД 77-01-2022, введено в действие приказом от 03.08.2015 №268а-О (<http://nsau.edu.ru/file/104821>: режим доступа свободный).

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра Учета и финансовых технологий

Вопросы для собеседования

по дисциплине «Риск-менеджмент»

Тема 1. Риск- как экономическая категория

1. В чем заключается сущность риска? Какие понятия риска, предлагаемые различными авторами, вы знаете? В чем сходства этих понятий, а в чем различия?

2. Укажите основные моменты, характерные для рискованной ситуации. Как вы считаете, для возникновения рискованной ситуации необходимо наличие всех перечисленных моментов?

3. Какие элементы отражают сущность риска?

4. Укажите основные черты риска. Охарактеризуйте их и приведите примеры.

5. Что такое устойчивость предприятия и устойчивость среды? Укажите их основные характеристики.

6. Какие виды устойчивости внутренней среды Вы знаете? Как взаимосвязаны основные типы устойчивости предприятия и факторы риска?

Тема 2. Виды и классификация рисков

1. Что такое классификация? Зачем необходимо классифицировать риски?

2. Какие классификации рисков существуют? В чем их существенные сходства и различия?

3. Перечислите основные принципы классификации рисков.

4. Укажите виды рисков, в зависимости от основной причины их возникновения.

5. Укажите виды рисков по сфере их возникновения.

6. Какие риски должен учитывать менеджер при осуществлении предпринимательской деятельности?

7. С какими видами рисков предпринимательской деятельности менеджер может успешно бороться?

Тема 3. Организация риск-менеджмента на предприятии.

1. В чем заключается сущность риск-менеджмента на предприятии? Каждое ли предприятие должно применять риск-менеджмент в своей деятельности? От чего будет зависеть необходимость применения риск-менеджмента?

2. Укажите основные элементы риск-менеджмента на предприятии. Различаются ли указанные элементы в зависимости от вида деятельности предприятия?

3. Перечислите функции объекта управления в риск-менеджменте. Приведите примеры реализации функций объекта управления в риск-менеджменте на примере предприятия, с деятельностью которого вы знакомы.

4. Перечислите функции субъекта управления в риск-менеджменте. Приведите примеры реализации функций субъекта управления в риск-менеджменте на примере предприятия, с деятельностью которого вы знакомы.

5. В чем заключается сущность организации риск-менеджмента на предприятии? Перечислите основные этапы организации риск-менеджмента на предприятии.

6. Охарактеризуйте особенности функционирования службы риск-менеджмента в организационной структуре организации.

Тема 4. Технология анализа и оценки рисков предприятия

1. Какие вероятностные и статистические показатели применяются для оценки риска в условиях частичной неопределенности? В чем их различия?

3. Назовите методы количественной оценки рисков предприятия.

4. Назовите методы экспертных оценок при определении степени риска

Тема 5. Управление рисками в системе риск-менеджмента

1. Какие факторы влияют на выбор приемов управления риском? Кто принимает решение о применении того или иного метода снижения риска?

2. Какие методы снижения риска Вы знаете? Укажите их основные достоинства и недостатки. Приведите примеры применения методов снижения риска для человека, семьи, предприятия.

3. В чем заключается сущность избежания риска? В каких случаях целесообразно применять данный метод?

4. В чем заключается сущность принятия риска? Какими ресурсами необходимо обладать предприятию для осуществления метода принятия риска?

5. Какие ограничения по отношению к ресурсам необходимо учитывать в случае их использования предприятием?

6. В чем заключается сущность смягчения риска? Дайте определение понятия страхование. Чем страхование отличается от самострахования?

7. В чем заключается сущность передачи риска? Всегда ли передача риска будет эффективным методом?

8. В чем заключается сущность диверсификации риска? Каким образом можно диверсифицировать риск?

Тема 6. Основы антикризисного управления

1. В чем заключается сущность антикризисного управления?

2. Назовите факторы рискованного развития организации.

3. Система антикризисного управления в организации.

4. Охарактеризуйте методику оценки риска банкротства предприятия

Тема 7. Риск-менеджмент в особых категориях проектного управления

1. Какие специфические виды риска присущи различным областям народного хозяйства? Приведите примеры рисков, которые могут возникнуть у любого предприятия, вне зависимости от его сферы деятельности.

2. Почему каждому предприятию необходимо разрабатывать собственную стратегию по минимизации рисков? Как данная стратегия должна учитывать сильные и слабые стороны предприятия? Внешние возможности и угрозы?

3. Охарактеризуйте особенности управление рисками в банковском бизнесе. Какие виды рисков относятся непосредственно к банковским, а какие к общим? Опишите основные меры по управлению банковскими рисками.

4. Риск-менеджмент промышленных предприятий. Какие виды рисков характерны для промышленных предприятий в целом, в зависимости от отрасли деятельности?

5. Особенности риск-менеджмента в сфере агропромышленного производства. Перечислите основные особенности агропромышленного производства. Какие методы минимизации рисков в аграрном секторе вам известны?

ФГБОУ ВО Новосибирский ГАУ
Кафедра Учета и финансовых технологий

Вопросы для подготовки к экзамену
по дисциплине «Риск-менеджмент»

1. Понятия риска и неопределенности в хозяйственной деятельности. сущность риска.
2. Сущность и содержание риска как экономической категории.
3. Возможные причины возникновения рисков.
4. Функции риска.
5. Классификационная система рисков.
6. Коммерческие риски.
7. Финансовые риски.
8. Производственные риски
9. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента.
10. Функции риск-менеджмента.
11. Система управления рисками.
12. Организация системы риск-менеджмента на предприятии.
13. Общий алгоритм организации риск-менеджмента.
14. Оценка и анализ рисков организации.
15. Методы количественной оценки рисков предприятия.
16. Методы экспертных оценок при определении степени риска
17. Основные подходы к управлению рисками.
18. Методы управления рисками организации: сущность, возможности использования.
19. Системный подход к управлению рисками организации и разработка интеграционной стратегии риск-менеджмента.
20. Контроль и оценка эффективности мероприятий по управлению рискам
21. Сущность антикризисного управления.
22. Факторы рискованного развития организации.
23. Система антикризисного управления в организации.
24. Диагностика риска банкротства предприятия
25. Риск-менеджмент инвестиционного проекта.
26. Риск-менеджмент в предпринимательской деятельности.
27. Риск-менеджмент в кредитных организациях.
28. Риск-менеджмент в сельскохозяйственных проектах.

Новосибирский государственный аграрный университет

Факультет Экономики и
управления

38.03.01 Экономика

экзамен по дисциплине

Риск-менеджмент

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой

Учета и финансовых
технологий

_____ О.С. Шинделова
(подпись)

Билет № 1

1. Сущность и содержание риска как экономической категории.
2. Система управления рисками.
3. Сущность антикризисного управления.

Экзаменатор _____ И.О. Шишкина

ЗАДАНИЯ
ДЛЯ ОЦЕНКИ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ
по дисциплине «Риск-менеджмент»

ПК-3 - Способностью выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами

1. Риск – это...

а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна

в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

Ответ: в

2. Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым

а) потери рабочего времени

б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

в) невыполнение сроков сдачи объекта

г) потери материалов

Ответ: а

3. Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым

а) потери ценных бумаг

б) потери сырья

в) невыполнение сроков сдачи объекта

Ответ: а

4. Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени

а) невыполнение сроков сдачи объекта

б) потери ценных бумаг

в) выплата штрафа

Ответ: а

5. Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям

а) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

б) потери ценных бумаг

в) ущерб репутации

Ответ: в

6. Анализ риска – это...

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

Ответ: б

7. Идентификация риска – это...

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

Ответ: б

8. Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются

а) чистыми

б) критическими

в) спекулятивными

Ответ: в

9. VAR – это:

а) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);

б) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);

в) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);

г) объем риска (Volume of Accepted Risk)

Ответ: а

10. Главной функцией риск-менеджмента является:

а) создание чуткой системы управления рисками;

б) оценка риска по каждому проекту в компании;

в) оценка риска для компании в целом;

г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.

Ответ: в

11. Какие подходы выделяют при расчете VAR?

- а) эмпирический и параметрический.;
- б) логический;
- в) оценочный;
- г) ранжирование;

Ответ: а

12. Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?

- а) текущая стоимость актива;
- б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
- в) изменение стоимости в перспективе;
- г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
- д) все вышеперечисленные ответы верны;
- е) все вышеперечисленные ответы не верны.

Ответ: а

13. Волатильность – это:

- а) изменчивость рыночного спроса;
- б) постоянство рыночного спроса;
- в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
- г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.

Ответ: а

14. Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?

- а) организация разрешения риска;
- б) организация рискованных вложений капитала;
- в) организация работы по снижению величины риска;
- г) организация процесса страхования рисков;
- д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса;
- е) все перечисленное является функциями объекта управления
- ж) ничего из перечисленного не является функцией объекта управления.

Ответ: е

15. Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?

- а) нельзя рисковать многим ради малого;
- б) риск – дело благородное;

Ответ: а

16. Какие источники могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?

Ответ...

17. Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?

Ответ...

18. На чем основано подразделение рисков на спекулятивные и чистые

Ответ...

19. Что такое коммерческий риск?

Ответ...

20. На какие виды подразделяются финансовые риски?

Ответ...

21. С чем связан валютный риск?

Ответ...

22. Что такое инфляционный риск?

Ответ...

23. Что такое системный риск?

Ответ...

24. Что такое деловой риск ?

Ответ...

25. Что такое инновационный риск?

Ответ...

26. Что относится к производственным рискам?

Ответ...

27. Как классифицируются риски по времени возникновения неопределенности ?

Ответ...

28. Как меняется процесс выбора оптимальных решений при наличии неопределенностей?

Ответ...

29. Какая связь между риском и доходностью?

Ответ...

30. Как называются методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса?

Ответ...

ПК-11 - Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

1. Для количественной оценки риска в сельском хозяйстве рассчитывается:

- а) отклонение от многолетнего тренда урожайности
- б) отклонение от среднероссийского тренда урожайности
- в) отклонение от среднерегионального тренда урожайности

Ответ: а

2. Что означает вероятность в процессе оценки риска объективным методом?

Ответ...

3. В чем состоит суть риск-менеджмента состоит

Ответ...

4. 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:

- а) изометрические шкалы;
- б) шкалы воздействия;
- в) шкалы риска.

Ответ: а

5. Как называются методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска?

Ответ...

6. Объективный метод определения вероятности основан на:

- а) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события
- б) экспертных оценках

Ответ: а

7. Субъективный метод определения вероятности основан на:

- а) вычислении частоты, с которой происходят некоторые события
- б) экспертных оценках

Ответ: б

8. В чем заключается необходимость риск-менеджмента в коммерческих предприятиях?

Ответ...